

## **États financiers intermédiaires non audités**

*Pour la période de six mois close le 30 septembre 2024*

*Les présents états financiers intermédiaires non audités ne contiennent pas le rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du Fonds (« RDRF ») du fonds d'investissement. Vous pouvez obtenir un exemplaire du RDRF intermédiaire gratuitement en communiquant avec nous d'une des façons indiquées à la rubrique Constitution du Fonds et renseignements sur les séries ou en visitant le site Web de SEDAR+ à [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca). Des exemplaires des états financiers annuels ou du RDRF annuel peuvent aussi être obtenus gratuitement des façons décrites ci-dessus.*

*Les porteurs de titres peuvent également communiquer avec nous de ces façons pour demander un exemplaire des politiques et procédures de vote par procuration, du dossier de divulgation des votes par procuration ou de la présentation d'informations trimestrielles sur le portefeuille du fonds d'investissement.*

### **AVIS DE NON-AUDIT DES ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES**

*Corporation Financière Mackenzie, le gestionnaire du Fonds de revenu stratégique mondial Mackenzie (le « Fonds »), nomme des auditeurs indépendants pour auditer les états financiers annuels du Fonds. Conformément aux lois sur les valeurs mobilières du Canada (Règlement 81-106), si un auditeur n'a pas revu les états financiers intermédiaires, cela doit être divulgué dans un avis complémentaire.*

*Les auditeurs indépendants du Fonds n'ont pas revu les présents états financiers intermédiaires conformément aux normes établies par l'Institut Canadien des Comptables Agréés.*



# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Aux (en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)	Actif net attribuable aux porteurs de titres (note 3)						
			par titre		par série				
			30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)	30 sept. 2024	31 mars 2024 (Audité)			
<b>ACTIF</b>									
<b>Actifs courants</b>									
Placements à la juste valeur	2 172 300	2 103 763	Série A	14,19	13,64	426 690	433 591		
Trésorerie et équivalents de trésorerie	27 943	22 151	Série AR	15,15	14,29	81 115	78 991		
Intérêts courus à recevoir	7 762	8 195	Série B	24,85	23,45	4 192	4 317		
Dividendes à recevoir	1 382	1 847	Série D	15,74	15,04	6 750	5 867		
Sommes à recevoir pour placements vendus	17 768	440	Série F	14,35	13,70	485 669	453 351		
Sommes à recevoir pour titres émis	423	979	Série F8	12,77	12,37	5 910	5 440		
Sommes à recevoir du gestionnaire	24	23	Série FB	11,00	10,51	1 896	1 999		
Marge sur instruments dérivés	1 497	3 341	Série G	13,49	12,73	14	13		
Actifs dérivés	6 654	2 610	Série GF	16,59	15,83	26 031	27 212		
<b>Total de l'actif</b>	<b>2 235 753</b>	<b>2 143 349</b>	Série GF8	15,93	15,43	1 146	1 131		
			Série GLF	16,58	15,82	5 286	4 962		
			Série GO	16,77	15,93	30	28		
<b>PASSIF</b>			Série GPW	16,37	15,70	26 918	32 152		
<b>Passifs courants</b>			Série GPWFB	16,59	15,83	3 643	3 598		
Sommes à payer pour placements achetés	5 269	2 065	Série GPWT8	15,71	15,30	154	145		
Sommes à payer pour titres rachetés	417	2 413	Série GPWX	16,77	15,93	2 146	2 446		
Sommes à payer au gestionnaire	325	313	Série GPWX8	16,11	15,52	3	3		
Passifs dérivés	4 590	3 634	Série GW	16,35	15,70	704	685		
Impôt à payer	564	185	Série I	16,23	15,32	105	99		
<b>Total du passif</b>	<b>11 165</b>	<b>8 610</b>	Série OJ	13,54	12,77	97	91		
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>2 224 588</b>	<b>2 134 739</b>	Série O	16,30	15,48	56 786	52 522		
			Série O5	16,25	15,43	4	73		
			Série PW	12,14	11,65	903 045	849 470		
			Série PWFB	10,34	9,87	23 448	21 413		
			Série PWR	12,36	11,66	44 196	36 197		
			Série PWT5	14,14	13,57	61 397	59 965		
			Série PWT8	11,00	10,72	6 476	5 948		
			Série PWX	17,30	16,43	9 098	9 389		
			Série PWX8	12,35	11,91	290	297		
			Série R	11,51	10,86	1	1		
			Série S	12,80	12,07	2	2		
			Série T5	11,97	11,50	40 172	42 244		
			Série T8	12,71	12,40	1 171	1 094		
			Série LB	16,33	15,69	1	1		
			Série LF	16,63	15,85	1	1		
			Série LW	16,38	15,68	1	1		
						<b>2 224 588</b>	<b>2 134 739</b>		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	2024 \$	2023 \$	Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation (note 3)			
			par titre		par série	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>Revenus</b>						
Dividendes	14 019	16 893				
Revenus d'intérêts aux fins de distribution	23 315	22 392				
Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets						
Profit (perte) net(te) réalisé(e)	77 705	28 856				
Profit (perte) net(te) latent(e)	49 899	(85 709)				
Revenu tiré du prêt de titres	79	113				
Revenu provenant des rabais sur les frais	69	93				
<b>Total des revenus (pertes)</b>	<b>165 086</b>	<b>(17 362)</b>				
<b>Charges (note 6)</b>						
Frais de gestion	17 198	16 213				
Rabais sur les frais de gestion	(11)	(17)				
Frais d'administration	2 031	1 914				
Intérêts débiteurs	7	10				
Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille	516	337				
Frais du comité d'examen indépendant	3	3				
Autre	–	2				
<b>Charges avant les montants absorbés par le gestionnaire</b>	<b>19 744</b>	<b>18 462</b>				
Charges absorbées par le gestionnaire	–	–				
<b>Charges nettes</b>	<b>19 744</b>	<b>18 462</b>				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, avant impôt</b>	<b>145 342</b>	<b>(35 824)</b>				
Impôt étranger retenu à la source	1 686	1 779				
Charge d'impôt étranger sur le résultat (recouvrée)	430	60				
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation</b>	<b>143 226</b>	<b>(37 663)</b>				
Série A	0,87	(0,27)	26 884	(9 326)		
Série AR	0,93	(0,29)	5 077	(1 562)		
Série B	1,52	(0,44)	271	(92)		
Série D	1,08	(0,28)	424	(89)		
Série F	0,99	(0,19)	33 042	(6 193)		
Série F8	0,87	(0,16)	380	(68)		
Série FB	0,73	(0,15)	133	(29)		
Série G	0,87	(0,22)	1	–		
Série GF	1,13	(0,28)	1 852	(533)		
Série GF8	1,10	(0,29)	81	(20)		
Série GLF	1,14	(0,29)	360	(90)		
Série GO	1,23	(0,22)	2	(1)		
Série GPW	0,97	(0,32)	1 734	(813)		
Série GPWFB	1,14	(0,30)	251	(83)		
Série GPWT8	1,01	(0,33)	9	(3)		
Série GPWX	1,16	(0,24)	154	(45)		
Série GPWX8	1,19	(0,25)	–	–		
Série GW	1,03	(0,29)	44	(22)		
Série I	1,05	(0,26)	7	(1)		
Série OJ	0,86	(0,24)	6	(2)		
Série O	1,19	(0,15)	4 057	(507)		
Série O5	0,82	(1,92)	2	(2)		
Série PW	0,77	(0,22)	56 581	(16 047)		
Série PWFB	0,72	(0,12)	1 575	(282)		
Série PWR	0,79	(0,23)	2 619	(601)		
Série PWT5	0,89	(0,25)	3 939	(1 113)		
Série PWT8	0,71	(0,19)	410	(112)		
Série PWX	1,25	(0,15)	683	(99)		
Série PWX8	0,91	(0,11)	21	(5)		
Série R	0,84	1,60	–	1 018		
Série S	0,93	(0,11)	–	–		
Série T5	0,73	(0,23)	2 558	(922)		
Série T8	0,79	(0,24)	69	(19)		
Série LB	1,03	(0,35)	–	–		
Série LF	1,17	(0,28)	–	–		
Série LW	1,07	(0,59)	–	–		
			<b>143 226</b>	<b>(37 663)</b>		

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	Total		Série A		Série AR		Série B		Série D	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>2 134 739</b>	<b>1 994 784</b>	<b>433 591</b>	<b>460 461</b>	<b>78 991</b>	<b>71 327</b>	<b>4 317</b>	<b>4 707</b>	<b>5 867</b>	<b>4 343</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	143 226	(37 663)	26 884	(9 326)	5 077	(1 562)	271	(92)	424	(89)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(17 325)	(17 769)	(2 297)	(2 637)	(411)	(408)	(24)	(29)	(68)	(59)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(31 662)	(33 581)	(7 787)	(8 908)	–	–	–	–	(74)	(65)
Rabais sur les frais de gestion	(11)	(17)	(1)	(1)	–	–	–	(1)	–	–
<b>Total des distributions versées aux porteurs de titres</b>	<b>(48 998)</b>	<b>(51 367)</b>	<b>(10 085)</b>	<b>(11 546)</b>	<b>(411)</b>	<b>(408)</b>	<b>(24)</b>	<b>(30)</b>	<b>(142)</b>	<b>(124)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	198 385	222 350	47 437	30 748	6 221	5 200	2	1	1 110	1 518
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions	43 831	46 171	9 723	11 146	411	408	22	27	126	111
Paiements au rachat de titres	(246 595)	(204 374)	(80 860)	(59 313)	(9 174)	(4 801)	(396)	(430)	(635)	(609)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(4 379)</b>	<b>64 147</b>	<b>(23 700)</b>	<b>(17 419)</b>	<b>(2 542)</b>	<b>807</b>	<b>(372)</b>	<b>(402)</b>	<b>601</b>	<b>1 020</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>89 849</b>	<b>(24 883)</b>	<b>(6 901)</b>	<b>(38 291)</b>	<b>2 124</b>	<b>(1 163)</b>	<b>(125)</b>	<b>(524)</b>	<b>883</b>	<b>807</b>
<b>À la clôture</b>	<b>2 224 588</b>	<b>1 969 901</b>	<b>426 690</b>	<b>422 170</b>	<b>81 115</b>	<b>70 164</b>	<b>4 192</b>	<b>4 183</b>	<b>6 750</b>	<b>5 150</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>31 789</b>	<b>35 021</b>	<b>5 527</b>	<b>5 401</b>	<b>184</b>	<b>217</b>	<b>390</b>	<b>303</b>
Émis			3 440	2 362	425	395	–	–	73	107
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	–	–
Réinvestissement des distributions			706	861	29	31	1	1	8	8
Rachetés			(5 870)	(4 558)	(626)	(364)	(16)	(20)	(42)	(43)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>30 065</b>	<b>33 686</b>	<b>5 355</b>	<b>5 463</b>	<b>169</b>	<b>198</b>	<b>429</b>	<b>375</b>

  

	Série F		Série F8		Série FB		Série G		Série GF	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	<b>453 351</b>	<b>415 435</b>	<b>5 440</b>	<b>5 315</b>	<b>1 999</b>	<b>2 080</b>	<b>13</b>	<b>14</b>	<b>27 212</b>	<b>–</b>
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	33 042	(6 193)	380	(68)	133	(29)	1	–	1 852	(533)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(5 661)	(5 579)	(67)	(70)	(21)	(23)	–	–	(329)	(197)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(5 309)	(5 552)	(141)	(148)	(24)	(28)	–	–	(291)	(278)
Rabais sur les frais de gestion	(1)	(1)	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions versées aux porteurs de titres</b>	<b>(10 971)</b>	<b>(11 132)</b>	<b>(208)</b>	<b>(218)</b>	<b>(45)</b>	<b>(51)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(620)</b>	<b>(475)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	49 596	36 796	928	185	701	363	–	–	–	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	29 198
Réinvestissement des distributions	8 357	8 543	15	26	45	51	–	–	584	451
Paiements au rachat de titres	(47 706)	(37 847)	(645)	(405)	(937)	(626)	–	–	(2 997)	(1 806)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>10 247</b>	<b>7 492</b>	<b>298</b>	<b>(194)</b>	<b>(191)</b>	<b>(212)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(2 413)</b>	<b>27 843</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>32 318</b>	<b>(9 833)</b>	<b>470</b>	<b>(480)</b>	<b>(103)</b>	<b>(292)</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>(1 181)</b>	<b>26 835</b>
<b>À la clôture</b>	<b>485 669</b>	<b>405 602</b>	<b>5 910</b>	<b>4 835</b>	<b>1 896</b>	<b>1 788</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>26 031</b>	<b>26 835</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>										
<b>Titres en circulation, à l'ouverture</b>			<b>33 101</b>	<b>31 838</b>	<b>440</b>	<b>437</b>	<b>190</b>	<b>207</b>	<b>1 719</b>	<b>–</b>
Émis			3 573	2 838	74	16	66	37	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)			–	–	–	–	–	–	–	1 946
Réinvestissement des distributions			602	663	1	2	4	5	36	31
Rachetés			(3 438)	(2 923)	(52)	(34)	(88)	(63)	(186)	(121)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>			<b>33 838</b>	<b>32 416</b>	<b>463</b>	<b>421</b>	<b>172</b>	<b>186</b>	<b>1 569</b>	<b>1 856</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE LA SITUATION FINANCIÈRE (suite)

Pour les périodes closes les 30 septembre  
(en milliers de \$, sauf les montants par titre)

	Série GF8		Série GLF		Série GO		Série GPW		Série GPWFB	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	1 131	–	4 962	–	28	–	32 152	–	3 598	–
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	81	(20)	360	(90)	2	(1)	1 734	(813)	251	(83)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(14)	(8)	(62)	(31)	–	–	(201)	(128)	(44)	(29)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(29)	(22)	(57)	(44)	–	–	(471)	(495)	(39)	(40)
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	(1)	(1)	–	–
<b>Total des distributions versées aux porteurs de titres</b>	<b>(43)</b>	<b>(30)</b>	<b>(119)</b>	<b>(75)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(673)</b>	<b>(624)</b>	<b>(83)</b>	<b>(69)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	1	–	1	–	–	7	–	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	1 106	–	4 503	–	64	–	38 385	–	4 796
Réinvestissement des distributions	5	3	119	75	–	–	657	616	83	69
Paiements au rachat de titres	(28)	(3)	(37)	–	(1)	(15)	(6 952)	(3 503)	(206)	(736)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>(23)</b>	<b>1 106</b>	<b>83</b>	<b>4 578</b>	<b>–</b>	<b>49</b>	<b>(6 295)</b>	<b>35 505</b>	<b>(123)</b>	<b>4 129</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>15</b>	<b>1 056</b>	<b>324</b>	<b>4 413</b>	<b>2</b>	<b>48</b>	<b>(5 234)</b>	<b>34 068</b>	<b>45</b>	<b>3 977</b>
<b>À la clôture</b>	<b>1 146</b>	<b>1 056</b>	<b>5 286</b>	<b>4 413</b>	<b>30</b>	<b>48</b>	<b>26 918</b>	<b>34 068</b>	<b>3 643</b>	<b>3 977</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	73	–	314	–	2	–	2 047	–	227	–
Émis	–	–	–	–	–	–	–	1	–	2
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	74	–	300	–	4	–	2 559	–	320
Réinvestissement des distributions	–	–	7	5	–	–	41	42	5	5
Rachetés	(1)	–	(2)	–	–	(1)	(443)	(238)	(12)	(50)
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>72</b>	<b>74</b>	<b>319</b>	<b>305</b>	<b>2</b>	<b>3</b>	<b>1 645</b>	<b>2 364</b>	<b>220</b>	<b>277</b>

	Série GPWT8		Série GPWX		Série GPWX8		Série GW		Série I	
	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023	2024	2023
<b>ACTIF NET ATTRIBUABLE AUX PORTEURS DE TITRES</b>										
<b>À l'ouverture</b>	145	–	2 446	–	3	–	685	–	99	92
Augmentation (diminution) de l'actif net liée aux activités d'exploitation	9	(3)	154	(45)	–	–	44	(22)	7	(1)
Distributions versées aux porteurs de titres :										
Revenu de placement	(1)	(1)	(36)	(26)	–	–	(4)	(3)	(1)	(1)
Gains en capital	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Remboursement de capital	(5)	(4)	(14)	(18)	–	–	(12)	(14)	–	–
Rabais sur les frais de gestion	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Total des distributions versées aux porteurs de titres</b>	<b>(6)</b>	<b>(5)</b>	<b>(50)</b>	<b>(44)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(16)</b>	<b>(17)</b>	<b>(1)</b>	<b>(1)</b>
Opérations sur les titres :										
Produit de l'émission de titres	–	–	–	–	–	–	–	1	–	–
Titres émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	166	–	2 711	–	2	–	1 137	–	–
Réinvestissement des distributions	6	4	50	44	–	–	16	17	1	1
Paiements au rachat de titres	–	(2)	(454)	(123)	–	–	(25)	(154)	(1)	(1)
<b>Total des opérations sur les titres</b>	<b>6</b>	<b>168</b>	<b>(404)</b>	<b>2 632</b>	<b>–</b>	<b>2</b>	<b>(9)</b>	<b>1 001</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres</b>	<b>9</b>	<b>160</b>	<b>(300)</b>	<b>2 543</b>	<b>–</b>	<b>2</b>	<b>19</b>	<b>962</b>	<b>6</b>	<b>(2)</b>
<b>À la clôture</b>	<b>154</b>	<b>160</b>	<b>2 146</b>	<b>2 543</b>	<b>3</b>	<b>2</b>	<b>704</b>	<b>962</b>	<b>105</b>	<b>90</b>
<b>Augmentation (diminution) des titres du Fonds (en milliers) (note 7) :</b>	<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>		<b>Titres</b>	
Titres en circulation, à l'ouverture	9	–	154	–	–	–	44	–	6	6
Émis	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Émis et rachetés à la fusion (note 10)	–	11	–	181	–	–	–	76	–	–
Réinvestissement des distributions	1	–	3	3	–	–	1	1	–	1
Rachetés	–	–	(29)	(9)	–	–	(2)	(10)	–	–
<b>Titres en circulation, à la clôture</b>	<b>10</b>	<b>11</b>	<b>128</b>	<b>175</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>43</b>	<b>67</b>	<b>6</b>	<b>7</b>

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.





# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAUX DES FLUX DE TRÉSORERIE

Pour les périodes closes les 30 septembre (en milliers de \$)

	2024	2023
	\$	\$
<b>Flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation</b>		
Augmentation (diminution) nette de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation	143 226	(37 663)
Ajustements pour :		
Perte (profit) net(te) réalisé(e) sur les placements	(81 133)	(28 066)
Variation de la perte (du profit) net(te) latent(e) sur les placements	(49 984)	85 883
Achat de placements	(500 175)	(637 761)
Produit de la vente et de l'échéance de placements	545 521	506 974
(Augmentation) diminution des sommes à recevoir et autres actifs	2 741	18 827
Augmentation (diminution) des sommes à payer et autres passifs	391	48
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités d'exploitation</b>	<b>60 587</b>	<b>(91 758)</b>
<b>Flux de trésorerie liés aux activités de financement</b>		
Produit de l'émission de titres	146 862	192 984
Paiements au rachat de titres	(196 512)	(175 039)
Distributions versées, déduction faite des réinvestissements	(5 167)	(5 197)
<b>Entrées (sorties) nettes de trésorerie liées aux activités de financement</b>	<b>(54 817)</b>	<b>12 748</b>
<b>Augmentation (diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>	<b>5 770</b>	<b>(79 010)</b>
Trésorerie et équivalents de trésorerie, à l'ouverture	22 151	95 659
Incidence des fluctuations des taux de change sur la trésorerie et les équivalents de trésorerie	22	246
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>27 943</b>	<b>16 895</b>
Trésorerie	8 117	16 895
Équivalents de trésorerie	19 826	–
<b>Trésorerie et équivalents de trésorerie, à la clôture</b>	<b>27 943</b>	<b>16 895</b>
<b>Informations supplémentaires sur les flux de trésorerie liés aux activités d'exploitation :</b>		
Dividendes reçus	14 484	16 553
Impôts étrangers payés	1 737	1 839
Intérêts reçus	23 748	20 849
Intérêts versés	7	10

Les notes annexes font partie intégrante de ces états financiers.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS</b>					
407 International Inc. 1,80 % 22-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 036 000	1 045	1 023
407 International Inc. 4,22 % 14-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	790 000	790	806
407 International Inc. 3,43 % 01-06-2033, série MTN	Canada	Sociétés – Non convertibles	256 000	278	248
407 International Inc. 4,86 % 31-07-2053	Canada	Sociétés – Non convertibles	313 000	313	329
AbbVie Inc. 4,95 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	690 000 USD	929	970
AerCap Ireland Capital DAC 3,00 % 29-10-2028	Irlande	Sociétés – Non convertibles	450 000 USD	518	575
Aéroports de Montréal 3,92 % 12-06-2045, rachetables 2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	50	50
AIMCo Realty Investors LP 2,20 % 04-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	614
AIMCo Realty Investors LP 2,71 % 01-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	100 000	90	96
Air Lease Corp. 5,40 % 01-06-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 148 000	4 146	4 345
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082 (\$ CA)	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	737
Alimentation Couche-Tard inc. 2,95 % 25-01-2030, rachetables 2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	55 000 USD	72	69
Alimentation Couche-Tard inc. 5,59 % 25-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 073 000	1 073	1 157
Allegiant Travel Co. 7,25 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	592 000 USD	779	792
AltaGas Ltd., taux variable 11-01-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	454
Altice International SARL 5,00 % 15-01-2028 144A	Luxembourg	Sociétés – Non convertibles	200 000 USD	227	229
Amaggi Luxembourg International SARL 5,25 % 28-01-2028	Bésil	Sociétés – Non convertibles	830 000 USD	1 048	1 105
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	99 110 000 MXN	7 629	6 665
American Tower Corp. 1,88 % 15-10-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	500 000 USD	666	583
Anglian Water Services Financing PLC 4,53 % 26-08-2032	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	546
ARC Resources Ltd. 3,47 % 10-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	716 000	687	687
Ascend Wellness Holdings Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 27-08-2025	États-Unis	Prêts à terme	85 091 USD	107	114
Ascend Wellness Holdings Inc. 12,75 % 16-07-2029, REGS	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	398 000 USD	516	510
Athene Global Funding 3,13 % 10-03-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	588
Athene Global Funding 2,10 % 24-09-2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	840 000	839	826
Athene Global Funding 5,11 % 07-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000	630	658
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,75 % 01-03-2029 144A	Irlande	Sociétés – Non convertibles	1 160 000 USD	1 552	1 616
Bank of America Corp., taux variable 15-09-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	259 000	247	251
Bank of America Corp., taux variable 04-04-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	611 000	611	590
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	49	50
Banque de Montréal, taux variable 27-10-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	41 000	42	44
Banque de Montréal, taux variable 07-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	19 000	19	20
Banque de Montréal, taux variable 03-07-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	920 000	920	955
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 327 000	2 328	2 437
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,16 % 03-02-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	761 000	725	756
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 29-12-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	553 000	560	565
La Banque de Nouvelle-Écosse 5,50 % 08-05-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	627 000	622	646
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 26-09-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	300 000	300	301
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 01-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	769	799
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 543 000	1 528	1 596
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	870 000	869	831
BCE Inc. 3,00 % 17-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	766 000	679	724
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 340 000	1 340	1 320
bclMC Realty Corp. 1,07 % 04-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	558 000	558	540
Becle SAB de CV 2,50 % 14-10-2031	Mexique	Sociétés – Non convertibles	2 370 000 USD	2 970	2 670
Bell Canada 5,25 % 15-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	980 000	979	1 038
Compagnie de téléphone Bell du Canada 5,15 % 24-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	458	485
Bimbo Bakeries USA Inc. 6,05 % 15-01-2029	Mexique	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	939	972
BP Capital Markets PLC 3,47 % 15-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	110 000	114	110
Broadcast Media Partners Holdings Inc. 4,50 % 01-05-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	170 000 USD	206	207
Broadcom Inc. 4,11 % 15-09-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 160	1 229
Brookfield Infrastructure Finance ULC 4,20 % 11-09-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	522 000	518	529
Brookfield Infrastructure Finance ULC 2,86 % 01-09-2032, rachetables 2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	133 000	133	120
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 199 000	2 235	2 200
Brookfield Renewable Partners ULC 4,25 % 15-01-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	676 000	676	688
Brookfield Renewable Partners ULC 5,29 % 28-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	331 000	349	354
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	355 000	355	342

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Bruce Power L.P. 4,00 % 21-06-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	677 000	664	681
Bruce Power L.P. 4,70 % 21-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	680 000	679	705
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	Allemagne	Gouvernements étrangers	12 709 000 EUR	18 405	19 269
CAE Inc. 5,54 % 12-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	567
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,00 % 25-05-2028	France	Gouvernements étrangers	3 300 000 EUR	4 851	5 054
Corporation Cameco 4,94 % 24-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	440
Canadian Core Real Estate LP 3,30 % 02-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	670	656
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 21-04-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	366 000	366	357
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	54 000	54	56
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada 4,40 % 10-05-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	599	623
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 2,54 % 28-02-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 905 000	1 842	1 854
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée 3,15 % 13-03-2029, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 830 000	3 008	2 792
Cannabist Co. Holdings Inc. 6,00 % 29-06-2025	Canada	Sociétés – Convertibles	170 000 USD	209	195
Cannabist Co. Holdings Inc. 9,50 % 03-02-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	120 000 USD	151	122
CAP SA 3,90 % 27-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	800 000 USD	1 000	890
Capital Power Corp. 4,99 % 23-01-2026, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	707
Capital Power Corp. 4,83 % 16-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 183 000	1 183	1 200
Capital Power Corp., taux variable 05-06-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	217 000	218	229
Capital Power Corp. 7,95 % 09-09-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	94 000	94	99
CCO Holdings LLC 4,25 % 01-02-2031, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 806 000 USD	5 439	5 737
Celulosa Arauco y Constitución SA 4,20 % 29-01-2030, rachetables 2029	Chili	Sociétés – Non convertibles	2 100 000 USD	2 758	2 724
Cemex SAB de CV, taux variable 08-09-2169	Mexique	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	726	799
Enovus Energy Inc. 3,50 % 07-02-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 330 000	1 326	1 323
Enovus Energy Inc. 3,75 % 15-02-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 802 000 USD	1 812	1 795
Centrais Elétricas Brasileiras SA 3,63 % 04-02-2025	Brésil	Sociétés – Non convertibles	530 000 USD	699	710
CGI inc. 3,99 % 07-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	690 000	690	698
CGI inc. 4,15 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	497
Charter Communications Operating LLC 2,80 % 01-04-2031, rachetables 2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	727	603
Charter Communications Operating LLC 2,30 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000 USD	821	687
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,46 % 30-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	342
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 5,40 % 01-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 034 000	1 034	1 098
CIFI Holdings (Group) Co. Ltd. 6,00 % 16-07-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 066 000 USD	344	140
Citadel Securities LP, prêt à terme de premier rang, taux variable 29-07-2030	États-Unis	Prêts à terme	1 980 148 USD	2 672	2 679
Clearway Energy LLC 3,75 % 15-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 022 000 USD	1 093	1 251
Clydesdale Acquisition Holdings Inc. 8,75 % 15-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	288 000 USD	368	398
Coastal GasLink Pipeline LP 4,69 % 30-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	512
Coastal GasLink Pipeline LP 4,91 % 30-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	720 000	720	760
Coastal GasLink Pipeline LP 5,19 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	590 000	590	631
Cogeco Communications inc. 2,99 % 22-09-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	530 000	530	487
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 387 000 USD	4 621	4 984
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	Chili	Sociétés – Non convertibles	660 000 USD	815	786
Cologix Data Centers Issuer LLC 4,94 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	67 000	67	66
Cologix Data Centers Issuer LLC 5,68 % 25-01-2052	Canada	Titres adossés à des créances hypothécaires	160 000	160	153
CommScope Inc. 4,75 % 01-09-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	100 000 USD	125	109
CommScope Technologies Finance LLC 8,25 % 01-03-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	316 000 USD	417	385
Constellation Software Inc. 5,16 % 16-02-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	572 000 USD	770	798
Continental Resources Inc. 5,75 % 15-01-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 468 000 USD	4 406	4 823
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	451 277	451	441
Cordelio Amalco GP I 4,09 % 30-09-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	456 458	456	447
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,50 % 16-09-2025	Chili	Sociétés – Non convertibles	1 972 000 USD	2 632	2 657
Corus Entertainment Inc. 5,00 % 11-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 849 000	910	901
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,70 % 12-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 625 000 USD	1 382	169
Country Garden Holdings 5,63 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 349 000 USD	1 948	241
CPPIB Capital Inc. 3,95 % 02-06-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 902 000	1 893	1 976
Credicorp Ltd. 2,75 % 17-06-2025, rachetables 2025	Pérou	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	399	399

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Fonds de placement immobilier Crombie 3,92 % 21-06-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	116 000	116	116
Fonds de placement immobilier Crombie 3,21 % 09-10-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 280 000	2 342	2 145
Fonds de placement immobilier Crombie 3,13 % 12-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	216 000	216	200
Curaleaf Holdings Inc. 8,00 % 15-12-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	872	868
DIRECTV Holdings LLC 5,88 % 15-08-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	128 000 USD	161	170
Dollarama inc. 5,53 % 26-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	823
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	369 000 USD	466	458
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 1,66 % 22-12-2025 (A)	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 080 000	3 079	3 000
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	480 000	480	467
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	496
Ecopetrol SA 4,63 % 02-11-2031	Colombie	Sociétés – Non convertibles	1 696 000 USD	1 746	1 967
Électricité de France SA 4,50 % 21-09-2028 144A	France	Sociétés – Non convertibles	2 131 000 USD	2 811	2 888
Electronic Arts Inc. 1,85 % 15-02-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	857 000 USD	1 003	995
Electronic Arts Inc. 2,95 % 15-02-2051	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	801 000 USD	755	752
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie 3,63 % 17-04-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	50 000	50	43
Empresas CMPC SA 3,00 % 06-04-2031	Chili	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 229	1 183
Enbridge Gas Inc. 5,70 % 06-10-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	561
Enbridge Inc. 4,90 % 26-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	448
Enbridge Inc. 3,10 % 21-09-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 130 000	1 128	1 031
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	12 100 000	11 577	12 118
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 870 000	3 864	4 049
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	520 000 USD	634	712
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031 144A	Italie	Sociétés – Non convertibles	270 000 USD	290	318
EPCOR Utilities Inc. 4,73 % 02-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	700 000	700	721
Banque Équitable 5,16 % 11-01-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	925
Exxon Mobil Corp. 3,10 % 16-08-2049	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 963 000 USD	4 049	3 939
Fair Isaac Corp. 4,00 % 15-06-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	482 000 USD	603	631
Fairfax Financial Holdings Ltd. 8,30 % 15-04-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 070 000 USD	1 617	1 524
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,23 % 14-06-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	375
Fairfax Financial Holdings Ltd. 3,95 % 03-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	752 000	754	745
Fairfax India Holdings Corp. 5,00 % 26-02-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 360 000 USD	1 702	1 694
Fédération des caisses Desjardins du Québec 3,80 % 24-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	301 000	301	302
Fonds de placement immobilier First Capital 3,45 % 01-03-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	389	432
Fonds de placement immobilier First Capital 5,46 % 12-06-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	340 000	340	356
First Capital Realty Inc. 5,57 % 01-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 548 000	1 573	1 646
First West Credit Union 9,19 % 09-08-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	550 000	550	612
Flynn America LP, prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	493 563 USD	602	662
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	350 000	350	343
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,58 % 22-02-2027	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	510 000	510	525
Compagnie Crédit Ford du Canada 5,24 % 23-05-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	678
Fortis Inc. 4,43 % 31-05-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 165 000	1 166	1 201
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 28-07-2026	États-Unis	Prêts à terme	24 442 USD	31	43
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme de second rang, taux variable 26-04-2028	États-Unis	Prêts à terme	23 724 USD	17	26
Gartner Inc. 3,63 % 15-06-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	4 244 000 USD	5 354	5 487
Financière General Motors du Canada Ltée 5,20 % 09-02-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	436
Financière General Motors du Canada Ltée 5,00 % 09-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	630 000	629	652
George Weston Ltée 4,19 % 05-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	578
GFL Environmental Inc. 5,13 % 15-12-2026 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000 USD	185	189
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000 USD	66	67
GFL Environmental Inc. 6,75 % 15-01-2031 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 304 000 USD	3 133	3 273
Gibson Energy Inc. 2,85 % 14-07-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	320 000	325	313
Gibson Energy Inc., taux variable 22-12-2080	Canada	Sociétés – Non convertibles	225 000	226	214
Glencore Funding LLC 5,70 % 08-05-2033 144A	Australie	Sociétés – Non convertibles	579 000 USD	799	822
GoDaddy Operating Co. LLC 3,50 % 01-03-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	15 000 USD	18	19
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 28-02-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	567 000	567	537
Gouvernement des Bahamas 6,95 % 20-11-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 460 000 USD	2 152	1 866

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Gouvernement des Bahamas 8,95 % 15-10-2032	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 581	1 655
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	4 400 000 BRL	11 747	9 853
Gouvernement du Brésil 6,25 % 18-03-2031	Brésil	Gouvernements étrangers	6 900 000 USD	9 385	9 752
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-02-2025	Canada	Gouvernement fédéral	100 000	99	100
Gouvernement du Canada 3,75 % 01-05-2025	Canada	Gouvernement fédéral	3 000	3	3
Gouvernement du Canada 1,25 % 01-03-2027	Canada	Gouvernement fédéral	1 204 000	1 108	1 162
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028	Canada	Gouvernement fédéral	171 000	169	175
Gouvernement de l'Allemagne 2,20 % 15-02-2034	Allemagne	Gouvernements étrangers	12 700 000 EUR	18 351	19 304
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	Allemagne	Gouvernements étrangers	23 760 000 EUR	23 615	18 323
Gouvernement du Mexique 2,66 % 24-05-2031	Mexique	Gouvernements étrangers	8 800 000 USD	10 531	10 244
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,50 % 15-05-2030	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	7 700 000 NZD	6 329	6 674
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033, REGS	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	24 596 000 NZD	18 502	20 084
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	Nouvelle-Zélande	Gouvernements étrangers	15 910 000 NZD	12 823	13 675
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	Afrique du Sud	Gouvernements étrangers	256 000 000 ZAR	15 138	18 572
Gouvernement des Bahamas 9,00 % 16-06-2029	Bahamas	Gouvernements étrangers	1 500 000 USD	1 524	2 103
GPS Blue Financing DAC 5,65 % 09-11-2041	Irlande	Sociétés – Non convertibles	4 300 000 USD	6 063	5 874
Fiducie de placement immobilier Granite 3,06 % 04-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	308	325
Fiducie de placement immobilier Granite 2,19 % 30-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 093 000	2 788	2 908
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 1,54 % 03-05-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 950 000	2 602	2 777
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto 6,47 % 02-02-2034, rachetables	Canada	Sociétés – Non convertibles	128 000	148	151
HCA Healthcare Inc. 3,50 % 01-09-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	190 000 USD	252	243
Heathrow Funding Ltd. 3,25 % 21-05-2025	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	346 000	364	344
Heathrow Funding Ltd. 2,69 % 13-10-2027	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	960 000	960	936
Heathrow Funding Ltd. 3,79 % 04-09-2030, rachetables 2030	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	990 000	990	976
Heathrow Funding Ltd. 3,73 % 13-04-2033	Royaume-Uni	Sociétés – Non convertibles	510 000	529	486
Hilton Worldwide Finance LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 09-11-2030	États-Unis	Prêts à terme	2 000 000 USD	2 715	2 707
Honda Canada Finance Inc. 4,87 % 23-09-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 359 000	1 362	1 407
Honda Canada Finance Inc. 5,73 % 28-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	520 000	520	559
Hyundai Capital Canada Inc. 4,90 % 31-01-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	385
iA Société financière inc., taux variable 20-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	450 000	450	476
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 490 000	1 490	1 469
L'Ordre Indépendant des Forestiers, taux variable 15-10-2035, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	490 000	490	440
Indy US Bidco LLC, prêt à terme B3 de premier rang, taux variable 05-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	249 286 USD	316	334
Intact Corporation financière 5,46 % 22-09-2032 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	623	652
Intact Corporation financière, taux variable 16-05-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	395
Intact Corporation financière, taux variable 31-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	180 000	180	175
Inter Pipeline Ltd. 3,48 % 16-12-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	670 000	656	665
Inter Pipeline Ltd. 4,23 % 01-06-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 884 000	1 934	1 896
Inter Pipeline Ltd. 5,71 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	497
Inter Pipeline Ltd. 3,98 % 25-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 580 000	3 580	3 406
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	387
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	779 000	775	783
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 1,75 % 31-01-2031	Supranationales	s.o.	4 600 000 USD	6 221	6 388
Banque internationale pour la reconstruction et le développement, taux variable 31-07-2033	Supranationales	s.o.	5 800 000 USD	7 952	7 985
Ivanhoe Cambridge II Inc. 2,30 % 12-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	379 000	379	378
Jadex Inc., prêt à terme de premier rang, taux variable 12-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	411 132 USD	532	546
Jazz Pharmaceuticals PLC 4,38 % 15-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 222 000 USD	1 504	1 600
JPMorgan Chase & Co. 1,90 % 05-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 580 000	1 580	1 521
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,70 % 11-11-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 200 000 USD	1 447	53
Kaisa Group Holdings 9,38 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	400 000 USD	359	26
Kaisa Group Holdings 8,65 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	900 000 USD	396	40
Kaisa Group Holdings 10,50 % 10-12-2024	Chine	Sociétés – Non convertibles	1 900 000 USD	1 132	78
Keyera Corp. 3,96 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 270 000	2 466	2 258
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	441	454
Keyera Corp., taux variable 10-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	602
Knight Health Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 17-12-2028	États-Unis	Prêts à terme	294 686 USD	352	229
Produits Kruger S.E.C. 6,00 % 24-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	200 000	200	199

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	110 000	110	105
LABL Escrow Issuer LLC 6,75 % 15-07-2026 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	136 000 USD	182	184
LABL Escrow Issuer LLC 10,50 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	233 000 USD	310	317
LABL Inc. 8,25 % 01-11-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	246 000 USD	279	301
LABL Inc. 8,63 % 01-10-2031 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	132 000 USD	178	178
Lamb Weston Holdings Inc. 4,38 % 31-01-2032 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 022 000 USD	1 197	1 283
LGI Homes Inc. 8,75 % 15-12-2028 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	35 000 USD	48	51
Liberty Utilities (Canada) LP 3,32 % 14-02-2050, rachetables 2049	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	274
Les Compagnies Loblaw ltée 4,49 % 11-12-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	40 000	44	41
Les Compagnies Loblaw ltée 2,28 % 07-05-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	498 000	501	464
Les Compagnies Loblaw ltée 5,34 % 13-09-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	470	506
Logan Group Co. Ltd. 4,70 % 06-07-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	3 483 000 USD	2 636	415
LSF10 XL Bidco SCA, prêt à terme B de premier rang, taux variable 30-03-2028	Luxembourg	Prêts à terme	315 784 EUR	465	435
Luxembourg Investment Co. 428 SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 22-10-2028	Luxembourg	Prêts à terme	393 102 USD	480	9
Magenta Security Holdings LLC, prêt à terme de premier rang (premier sorti), taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	39 302 USD	48	51
Magenta Security Holdings LLC, prêt à terme de premier rang (en deuxième position), taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	49 783 USD	61	47
Magenta Security Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang (en troisième position), taux variable 27-07-2028	États-Unis	Prêts à terme	172 929 USD	291	71
Banque Manuvie du Canada 1,54 % 14-09-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000	1 030	995
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 210 000	1 210	1 271
Société Financière Manuvie, taux variable 23-02-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	900 000	900	940
Société Financière Manuvie, taux variable 19-03-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	780 000	780	656
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	800 000	800	827
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	161 000 USD	180	209
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 9,25 % 15-04-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	378 000 USD	513	525
Mauser Packaging 7,88 % 15-04-2027, nom.	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	366 000 USD	506	513
Metro inc. 4,66 % 07-02-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	165 000	162	172
Micron Technology Inc. 5,38 % 15-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	910 000 USD	1 224	1 268
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	470 000 USD	599	611
Mozart Debt Merger Sub Inc. 3,88 % 01-04-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	473 000 USD	599	606
Mozart Debt Merger Sub Inc. 5,25 % 01-10-2029 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	700 000 USD	884	929
MPT Operating Partnership LP 3,50 % 15-03-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	144 000 USD	133	142
NAV CANADA 2,06 % 29-05-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	389
Nederlandse Waterschapsbank NV 1,00 % 28-05-2030	Pays-Bas	Gouvernements étrangers	1 200 000 USD	1 655	1 394
Nestlé Holdings Inc. 2,19 % 26-01-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	760 000	760	726
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	109 000 USD	143	136
Nexstar Escrow Inc. 5,63 % 15-07-2027 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	232 000 USD	308	311
NextEra Energy Capital Holdings Inc. 4,85 % 30-04-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 117	1 169
North West Redwater Partnership 2,80 % 01-06-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 460 000	1 457	1 367
North West Redwater Partnership 4,85 % 01-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	560 000	560	587
North West Redwater Partnership 3,70 % 23-02-2043, rachetables 2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	52 000	51	46
Nouvelle Autoroute 30 Financement Inc. 4,11 % 31-03-2042	Canada	Sociétés – Non convertibles	746 123	746	690
NVIDIA Corp. 2,00 % 15-06-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	567 000 USD	688	678
OMERS Finance Trust 2,60 % 14-05-2029	Canada	Gouvernements provinciaux	852 000	851	832
Ontario Power Generation Inc. 2,89 % 08-04-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	403	418
Ontario Power Generation Inc. 1,17 % 22-04-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	280 000	249	270
Ontario Power Generation Inc. 2,98 % 13-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	696 000	731	678
Ontario Power Generation Inc. 4,83 % 28-06-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	683
Ontario Teachers' Finance Trust 1,10 % 19-10-2027	Canada	Gouvernements provinciaux	490 000	489	463
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	720 000	718	766

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Open Text Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-01-2030	Canada	Prêts à terme	1 270 279 USD	1 728	1 726
Corporation Parkland du Canada 3,88 % 16-06-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 860 000	1 860	1 832
Corporation Parkland du Canada 4,38 % 26-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	140 000	140	135
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	390 000 USD	491	500
Corporation Pétroles Parkland 5,88 % 15-07-2027 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	26 000 USD	34	35
Corporation Pétroles Parkland 6,00 % 23-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 080 000	1 075	1 087
PayPal Holdings Inc. 2,65 % 01-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	600 000 USD	794	792
PayPal Holdings Inc. 2,30 % 01-06-2030, rachetables 2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	370 000 USD	518	454
Pembina Pipeline Corp. 4,02 % 27-03-2028, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 470 000	2 590	2 498
Pembina Pipeline Corp. 5,22 % 28-06-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	750 000	750	792
Pembina Pipeline Corp. 5,21 % 12-01-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	740 000	739	777
Pembina Pipeline Corp. 4,81 % 25-03-2044	Canada	Sociétés – Non convertibles	30 000	32	28
Pembina Pipeline Corp. 5,67 % 12-01-2054	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	610	648
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	810 000	810	759
Perrigo Co. PLC 3,15 % 15-06-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	38 000 USD	47	50
Petróleos de Venezuela 6,00 % 06-12-2024	Venezuela	Sociétés – Non convertibles	480 000 USD	153	63
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,65 % 19-05-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 571 000 USD	2 114	2 176
Pioneer Natural Resources Co. 2,15 % 15-01-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 838 000 USD	1 989	2 183
Prologis Inc. 4,70 % 01-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	870 000	868	901
Province de l'Alberta 2,05 % 01-06-2030	Canada	Gouvernements provinciaux	10 264 000	8 788	9 708
Province du Manitoba 3,80 % 05-09-2053	Canada	Gouvernements provinciaux	70 000	65	65
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	4 840 000	4 834	5 068
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	Canada	Gouvernements provinciaux	944 000	929	984
Province de Québec 3,65 % 20-05-2032	Canada	Gouvernements provinciaux	1 410 000	1 410	1 438
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	Canada	Gouvernements provinciaux	80 000	85	84
Province de la Saskatchewan 3,10 % 02-06-2050	Canada	Gouvernements provinciaux	10 000	10	8
PSP Capital Inc. 2,60 % 01-03-2032	Canada	Gouvernement fédéral	1 320 000	1 316	1 254
PSP Capital Inc. 4,15 % 01-06-2033	Canada	Gouvernement fédéral	120 000	121	126
Quasar Intermediate Holdings Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 20-01-2029	États-Unis	Prêts à terme	392 000 USD	485	359
Reliance LP 2,68 % 01-12-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	430 000	430	415
Reliance LP 2,67 % 01-08-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	650 000	650	619
Reliance LP 5,25 % 15-05-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	540 000	540	566
Renesas Electronics Corp. 1,54 % 26-11-2024	Japon	Sociétés – Non convertibles	560 000 USD	706	753
Renesas Electronics Corp. 2,17 % 25-11-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	650 000 USD	819	837
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 709 000	1 635	1 700
Rogers Communications Inc. 5,70 % 21-09-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 440 000	1 438	1 535
Rogers Communications Inc. 3,75 % 15-04-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 279 000	1 272	1 270
Rogers Communications Inc. 2,90 % 09-12-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 633 000	1 621	1 526
Rogers Communications Inc. 5,25 % 15-04-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	329 000	327	331
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	368 000 USD	467	489
Banque Royale du Canada 4,61 % 26-07-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	27 000	27	28
Banque Royale du Canada, taux variable 03-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 020 000	1 020	1 066
Banque Royale du Canada, taux variable 08-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 819 000	1 819	1 880
Sagen MI Canada Inc. 3,26 % 05-03-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	570 000	570	516
Sagen MI Canada Inc., taux variable 24-03-2081	Canada	Sociétés – Non convertibles	420 000	420	390
Saputo inc. 2,88 % 19-11-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	359
Saudi Arabian Oil Co. 5,25 % 17-07-2034	Arabie saoudite	Sociétés – Non convertibles	2 000 000 USD	2 730	2 782
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029 144A	Hong Kong	Sociétés – Non convertibles	5 300 000 USD	6 422	6 782
Secure Energy Services Inc. 6,75 % 22-03-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	93 000	93	94
Sienna Senior Living Inc. 3,11 % 04-11-2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	260 000	260	260
Sienna Senior Living Inc. 3,45 % 27-02-2026, rachetables 2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	330 000	330	327
Sienna Senior Living Inc. 2,82 % 31-03-2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 310 000	2 408	2 243
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 5,95 % 04-02-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	300 000 USD	93	29
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 05-08-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	2 959 000 USD	1 434	289
Sino-Ocean Group Holding Ltd. 4,75 % 14-01-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	675 000 USD	217	66
SK Neptune Husky Group SARL, prêt à terme (paiement en nature) bon à ce jour, non garanti, taux variable 31-12-2025	Luxembourg	Prêts à terme	38 926 USD	50	24
Source Energy Services Canada LP 10,50 % 15-03-2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	290 738	300	292
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,32 % 01-02-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	270 000	270	273
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd. 4,62 % 01-02-2032	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	445

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
South Bow Canadian Infrastructure Holdings Ltd., taux variable 01-03-2055 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 030 000 USD	1 413	1 445
South Coast British Columbia Transportation Authority 1,60 % 03-07-2030	Canada	Administrations municipales	840 000	840	772
Southwestern Energy Co. 4,75 % 01-02-2032	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	851 000 USD	1 035	1 102
Spa US HoldCo Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 12-03-2028	États-Unis	Prêts à terme	395 848 USD	491	536
Specialty Pharma III Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 24-02-2028	États-Unis	Prêts à terme	378 300 USD	469	504
Stella-Jones Inc. 4,31 % 01-10-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	440 000	440	442
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 010 000	1 010	973
Financière Sun Life inc., taux variable 10-08-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	879 000	874	914
Financière Sun Life inc., taux variable 04-07-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	291 000	291	313
Financière Sun Life inc., taux variable 01-10-2035	Canada	Sociétés – Non convertibles	860 000	859	775
Financière Sun Life inc., taux variable 15-05-2036	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 110 000	1 110	1 172
Sunac China Holdings Ltd. 6,00 % 30-09-2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	257 678 USD	113	43
Sunac China Holdings Ltd. 6,25 % 30-09-2026	Chine	Sociétés – Non convertibles	257 990 USD	104	38
Sunac China Holdings Ltd. 6,50 % 30-09-2027	Chine	Sociétés – Non convertibles	516 608 USD	180	70
Sunac China Holdings Ltd. 6,75 % 30-09-2028	Chine	Sociétés – Non convertibles	775 851 USD	243	96
Sunac China Holdings Ltd. 7,00 % 30-09-2029	Chine	Sociétés – Non convertibles	776 789 USD	194	84
Sunac China Holdings Ltd. 7,25 % 30-09-2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	365 332 USD	85	37
Sunac China Holdings Ltd. 1,00 % 30-09-2032	Chine	Sociétés – Non convertibles	310 794 USD	86	33
Suncor Énergie Inc. 5,40 % 17-11-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 120 000	1 118	1 161
Suncor Énergie Inc. 3,75 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	2 228 000 USD	2 349	2 275
Suncor Énergie Inc. 3,95 % 04-03-2051	Canada	Sociétés – Non convertibles	460 000	455	394
Supérieur Plus S.E.C. 4,50 % 15-03-2029 144A	Canada	Sociétés – Non convertibles	150 000 USD	191	193
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	Brésil	Sociétés – Non convertibles	985 000 USD	1 135	1 216
Suzano SA 3,75 % 15-01-2031	Brésil	Sociétés – Non convertibles	490 000 USD	677	609
TELUS Corp. 4,80 % 15-12-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	250 000	250	260
TELUS Corp. 3,30 % 02-05-2029, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	272 000	264	267
TELUS Corp. 3,15 % 19-02-2030, rachetables 2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 032 000	1 023	995
TELUS Corp. 4,65 % 13-08-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	600 000	599	617
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	610 000	509	561
TELUS Corp. 4,95 % 28-03-2033	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	369	386
Tencent Holdings Ltd. 2,39 % 03-06-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	420 000 USD	578	513
Tencent Music Entertainment Group 1,38 % 03-09-2025, rachetables 2025	Chine	Sociétés – Non convertibles	290 000 USD	381	381
Tencent Music Entertainment Group 2,00 % 03-09-2030, rachetables 2030	Chine	Sociétés – Non convertibles	210 000 USD	275	247
Tenet Healthcare Corp. 4,38 % 15-01-2030	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	110 000 USD	138	143
Tenet Healthcare 4,25 % 01-06-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	680 000 USD	817	889
Teranet Holdings LP 3,72 % 23-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 520 000	1 520	1 479
TerraForm Power Operating LLC 4,75 % 15-01-2030, rachetables 2025 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	40 000 USD	53	52
Thomson Reuters Corp. 2,24 % 14-05-2025, rachetables 2025	Canada	Sociétés – Non convertibles	930 000	930	920
T-Mobile USA Inc. 2,55 % 15-02-2031, cat. B	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	516	458
T-Mobile USA Inc. 5,20 % 15-01-2033	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	730 000 USD	942	1 022
Groupe TMX Ltée 2,30 % 11-12-2024, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	400 000	401	399
Groupe TMX Ltée 3,78 % 05-06-2028, rachetables 2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	470 000	472	474
Groupe TMX Ltée 4,68 % 16-08-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	370 000	370	387
Groupe TMX Ltée 2,02 % 12-02-2031	Canada	Sociétés – Non convertibles	360 000	360	325
Toronto Hydro Corp. 4,95 % 13-10-2052	Canada	Sociétés – Non convertibles	98 000	101	105
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 09-04-2034	Canada	Sociétés – Non convertibles	850 000	850	889
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-10-2082	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 190 000	1 190	1 246
Tourmaline Oil Corp. 2,53 % 12-02-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	380 000	380	363
Crédit Toyota Canada Inc. 4,45 % 26-01-2026	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 107 000	1 097	1 117
Crédit Toyota Canada Inc. 3,73 % 02-10-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	662
Toyota Motor Corp. 1,34 % 25-03-2026	Japon	Sociétés – Non convertibles	380 000 USD	476	494
TransCanada PipeLines Ltd. 3,80 % 05-04-2027, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	5 639 000	5 494	5 673
TransCanada PipeLines Ltd. 5,28 % 15-07-2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 240 000	1 240	1 321
TransCanada PipeLines Ltd. 4,33 % 16-09-2047, rachetables 2047	Canada	Sociétés – Non convertibles	48 000	40	43
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	Canada	Sociétés – Non convertibles	3 555 000	3 628	3 497
Trulieve Cannabis Corp. 8,00 % 06-10-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	272 000 USD	336	357

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>OBLIGATIONS (suite)</b>					
Obligations du Royaume-Uni 0,88 % 31-07-2033	Royaume-Uni	Gouvernements étrangers	34 561 000 GBP	47 044	48 370
Obligations du Trésor des États-Unis 3,75 % 31-12-2028	États-Unis	Gouvernements étrangers	6 859 500 USD	9 159	9 336
Obligations du Trésor des États-Unis 4,25 % 30-06-2029	États-Unis	Gouvernements étrangers	25 000 000 USD	35 287	34 784
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 15-02-2031	États-Unis	Gouvernements étrangers	54 000 USD	63	63
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	19 400 000 USD	29 519	26 893
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	États-Unis	Gouvernements étrangers	1 318 000 USD	1 643	1 664
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	43 457 700 USD	56 982	57 709
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	États-Unis	Gouvernements étrangers	18 500 000 USD	24 270	25 204
Obligations du Trésor des États-Unis 4,38 % 15-05-2034	États-Unis	Gouvernements étrangers	37 829 000 USD	53 198	53 536
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2034	États-Unis	Gouvernements étrangers	41 950 000 USD	57 586	57 080
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	États-Unis	Gouvernements étrangers	2 780 000 USD	3 119	2 926
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	États-Unis	Gouvernements étrangers	19 641 000 USD	23 232	18 647
Obligations du Trésor des États-Unis 2,13 % 15-02-2054	États-Unis	Gouvernements étrangers	5 179 000 USD	7 453	7 456
UPC Broadband Finco BV 4,88 % 15-07-2031 144A	Pays-Bas	Sociétés – Non convertibles	2 780 000 USD	3 508	3 576
Administration de l'aéroport de Vancouver 1,76 % 20-09-2030, rachetables 2030	Canada	Sociétés – Non convertibles	213 000	180	193
Ventas Canada Finance Ltd. 5,40 % 21-04-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	830 000	830	872
Ventas Canada Finance Ltd. 5,10 % 05-03-2029	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	770 000	769	805
Veren Inc. 4,97 % 21-06-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	660 000	660	683
Verizon Communications Inc., taux variable 20-03-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	224 000 USD	280	304
Verizon Communications Inc. 2,38 % 22-03-2028	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 288 000	1 259	1 237
Vidéotron Itée 4,65 % 15-07-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	770 000	770	791
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	970 000	970	961
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	Canada	Sociétés – Non convertibles	1 310 000	1 310	1 328
Visa Inc. 1,10 % 15-02-2031	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	321 000 USD	364	364
Visa Inc. 2,00 % 15-08-2050	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	1 863 000 USD	1 589	1 530
Crédit VW Canada Inc. 4,42 % 20-08-2029	Allemagne	Sociétés – Non convertibles	820 000	827	832
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030 144A	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	3 025 000 USD	3 741	4 262
Wells Fargo & Co. 2,57 % 01-05-2026, rachetables 2025	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	260 000	270	258
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	États-Unis	Sociétés – Non convertibles	231 000	244	228
Groupe WSP Global Inc. 2,41 % 19-04-2028	Canada	Sociétés – Non convertibles	351 000	351	336
Groupe WSP Global Inc. 4,12 % 12-09-2029	Canada	Sociétés – Non convertibles	500 000	500	504
Zegona Holdco Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 09-07-2029	Royaume-Uni	Prêts à terme	1 080 000 USD	1 456	1 461
<b>Total des obligations</b>				<b>890 087</b>	<b>879 440</b>
<b>ACTIONS</b>					
AbbVie Inc.	États-Unis	Soins de santé	114 512	18 872	30 582
Air Liquide SA	France	Matériaux	45 441	4 872	11 872
Alphabet Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	124 229	18 796	27 863
Altria Group Inc.	États-Unis	Consommation de base	166 927	10 443	11 522
Amadeus IT Group SA	Espagne	Consommation discrétionnaire	59 582	5 088	5 817
Amazon.com Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	134 866	23 434	33 984
American Tower Corp., cat. A	États-Unis	Biens immobiliers	22 087	5 005	6 946
Analog Devices Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	44 996	11 723	14 006
Apple Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	162 123	26 730	51 085
ASSA ABLOY AB, B	Suède	Produits industriels	249 840	9 473	11 378
AstraZeneca PLC	Royaume-Uni	Soins de santé	97 003	17 619	20 443
Atlas Copco AB, A	Suède	Produits industriels	286 172	2 656	7 488
AutoZone Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2 210	7 996	9 415
BAE Systems PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	672 498	15 543	15 062
BCE Inc., priv., série AA	Canada	Services de communication	16 022	249	275
BCE Inc., priv., série AI	Canada	Services de communication	2 512	38	39
BCE Inc. 4,54 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de premier rang, série R, rachetables	Canada	Services de communication	13 980	253	222
Becton, Dickinson and Co.	États-Unis	Soins de santé	25 516	6 635	8 320
The Blackstone Group Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	62 623	10 391	12 968
Broadcom Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	83 889	3 730	19 570
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 46	Canada	Biens immobiliers	25 630	646	586
Brookfield Asset Management Inc., priv., série 48	Canada	Biens immobiliers	10 409	260	242
Brookfield Renewable Partners L.P., priv., série 13	Canada	Services publics	7 357	182	165
Cenovus Energy Inc., priv., série 7	Canada	Énergie	28 990	581	691

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ N <sup>bre</sup> d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
Chevron Corp.	États-Unis	Énergie	50 417	7 049	10 041
CME Group Inc.	États-Unis	Services financiers	67 305	12 633	20 084
The Coca-Cola Co.	États-Unis	Consommation de base	198 614	13 742	19 301
Colgate-Palmolive Co.	États-Unis	Consommation de base	125 763	13 529	17 656
Compass Group PLC	Royaume-Uni	Consommation discrétionnaire	193 350	7 445	8 382
ConocoPhillips	États-Unis	Énergie	65 688	9 103	9 352
CRH PLC	Irlande	Matériaux	108 961	8 036	13 666
DBS Group Holdings Ltd.	Singapour	Services financiers	451 559	12 770	18 137
Deutsche Börse AG	Allemagne	Services financiers	76 277	11 155	24 197
Diageo PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	153 879	7 181	7 264
Duke Energy Corp.	États-Unis	Services publics	111 748	15 198	17 424
Emera Inc., priv., série L	Canada	Services publics	12 750	319	249
Exxon Mobil Corp.	États-Unis	Énergie	103 619	16 626	16 426
Ferguson Enterprises Inc.	États-Unis	Produits industriels	43 065	10 780	11 565
Frontera Generation Holdings LLC	États-Unis	Énergie	1 737	4	1
Glencore PLC	Australie	Matériaux	2 143 612	11 551	16 608
Haleon PLC	Royaume-Uni	Consommation de base	1 389 000	7 963	9 828
Hannover Rueckversicherung SE, nom.	Allemagne	Services financiers	31 781	6 846	12 254
HDFC Bank Ltd.	Inde	Services financiers	402 228	8 660	11 260
Heineken Holding NV, A	Pays-Bas	Consommation de base	65 664	7 028	6 709
The Home Depot Inc.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	20 010	9 265	10 965
Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	Hong Kong	Services financiers	214 109	9 321	11 817
Intelsat Jackson Holdings SA	Luxembourg	Services de communication	9 877	422	421
ITOCHU Corp.	Japon	Produits industriels	269 000	14 441	19 540
Japan Exchange Group Inc.	Japon	Services financiers	851 400	9 168	14 942
Johnson & Johnson	États-Unis	Soins de santé	93 819	17 209	20 562
JPMorgan Chase & Co.	États-Unis	Services financiers	118 848	17 746	33 890
Keyence Corp.	Japon	Technologie de l'information	12 189	4 581	7 889
Lam Research Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	11 695	8 558	12 907
Linde PLC	Irlande	Matériaux	16 454	3 530	10 611
Les Compagnies Loblaw Itée 5,30 %, à div. cumulatif rachetable, priv. de second rang, série B	Canada	Consommation de base	2 273	59	53
London Stock Exchange Group PLC	Royaume-Uni	Services financiers	30 525	4 832	5 647
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	France	Consommation discrétionnaire	6 138	3 439	6 377
McDonald's Corp.	États-Unis	Consommation discrétionnaire	22 578	4 630	9 298
McKesson Corp.	États-Unis	Soins de santé	19 107	9 825	12 776
Merck & Co. Inc.	États-Unis	Soins de santé	82 892	12 760	12 730
Meta Platforms Inc., cat. A	États-Unis	Services de communication	40 047	18 276	31 002
Microsoft Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	96 664	14 791	56 250
Moody's Corp.	États-Unis	Services financiers	9 764	1 474	6 267
Motorola Solutions Inc.	États-Unis	Technologie de l'information	47 592	11 444	28 939
Nestlé SA, nom.	Suisse	Consommation de base	66 926	7 029	9 120
Novo Nordisk AS, B	Danemark	Soins de santé	71 766	2 493	11 559
NVIDIA Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	133 596	20 407	21 940
Oracle Corp.	États-Unis	Technologie de l'information	86 558	14 747	19 947
Parker Hannifin Corp.	États-Unis	Produits industriels	11 259	8 407	9 620
<sup>1</sup> Pernod Ricard SA	France	Consommation de base	23 181	4 164	4 740
Philip Morris International Inc.	États-Unis	Consommation de base	163 247	18 335	26 801
Polymetal International PLC	Russie	Matériaux	393	1	-
RELX PLC	Royaume-Uni	Produits industriels	141 184	8 176	9 025
Roche Holding AG Genussscheine	Suisse	Soins de santé	42 733	15 542	18 495
Ryanair Holdings PLC, CAAE	Irlande	Produits industriels	158 152	10 720	9 663
S&P Global Inc.	États-Unis	Services financiers	24 061	10 691	16 810
Safran SA	France	Produits industriels	46 453	5 852	14 827
SAP AG	Allemagne	Technologie de l'information	79 481	11 219	24 424
Shell PLC	Pays-Bas	Énergie	487 714	18 383	21 507
The Sherwin-Williams Co.	États-Unis	Matériaux	15 150	2 259	7 820
Siemens AG	Allemagne	Produits industriels	47 860	11 072	13 075
Sika AG	Suisse	Matériaux	13 227	2 439	5 933
Sony Corp.	Japon	Consommation discrétionnaire	504 200	7 576	13 241
Source Energy Services Ltd.	Canada	Énergie	13 086	32	149
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Taiwan	Technologie de l'information	508 120	6 486	20 904
Thermo Fisher Scientific Inc.	États-Unis	Soins de santé	11 979	8 481	10 021
Tokio Marine Holdings Inc.	Japon	Services financiers	43 200	2 149	2 143

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES PLACEMENTS (suite)

Au 30 septembre 2024

Nom du placement	Pays	Secteur	Valeur nominale/ Nbre d'actions/ de parts	Coût moyen (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
<b>ACTIONS (suite)</b>					
TransAlta Corp., perpétuelles, priv. série C	Canada	Services publics	3 910	73	77
TransAlta Corp., priv., série A	Canada	Services publics	33 983	444	509
Union Pacific Corp.	États-Unis	Produits industriels	39 387	11 022	13 129
UnitedHealth Group Inc.	États-Unis	Soins de santé	20 514	14 487	16 220
Veolia Environnement	France	Services publics	211 597	9 066	9 417
Visa Inc., cat. A	États-Unis	Services financiers	47 605	7 887	17 701
The Williams Companies Inc.	États-Unis	Énergie	278 106	11 671	17 169
Wolters Kluwer NV	Pays-Bas	Produits industriels	36 721	3 740	8 373
<b>Total des actions</b>				<b>819 654</b>	<b>1 238 187</b>
<b>OPTIONS</b>					
Options achetées (se reporter au tableau des options achetées)				986	846
<b>Total des options</b>				<b>986</b>	<b>846</b>
<b>FONDS/BILLETS NÉGOCIÉS EN BOURSE</b>					
<sup>2</sup> FNB de revenu à taux variable Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	504 408	8 777	8 635
<sup>2</sup> FNB mondial de dividendes Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	149 000	3 003	3 175
<sup>2</sup> FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	340 000	6 830	6 120
<sup>2</sup> FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	Canada	Fonds/billets négociés en bourse	50 000	4 300	4 193
<b>Total des fonds/billets négociés en bourse</b>				<b>22 910</b>	<b>22 123</b>
<b>FONDS COMMUNS DE PLACEMENT</b>					
<sup>3</sup> Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	158 830	1 589	1 633
<sup>3</sup> Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	952 505	9 525	9 542
<sup>3</sup> Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	389 347	3 987	6 561
<sup>3</sup> Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	Canada	Fonds communs de placement	181 416	1 783	1 616
<b>Total des fonds communs de placement</b>				<b>16 884</b>	<b>19 352</b>
<b>FONDS PRIVÉS</b>					
<sup>4</sup> Northleaf Private Credit II LP	Canada	Services financiers	811	8 291	8 051
<sup>5</sup> Sagard Credit Partners II LP	Canada	Services financiers	811	4 144	4 301
<b>Total des fonds privés</b>				<b>12 435</b>	<b>12 352</b>
Coûts de transaction				(1 182)	–
<b>Total des placements</b>				<b>1 761 774</b>	<b>2 172 300</b>
Instruments dérivés (se reporter au tableau des instruments dérivés)					2 064
Trésorerie et équivalents de trésorerie					27 943
Autres éléments d'actif moins le passif					22 281
<b>Actif net attribuable aux porteurs de titres</b>					<b>2 224 588</b>

<sup>1</sup> L'émetteur de ce titre est lié à Mackenzie. Voir note 1.

<sup>2</sup> Ce fonds négocié en bourse est géré par Mackenzie.

<sup>3</sup> Ce fonds est géré par Mackenzie.

<sup>4</sup> Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

<sup>5</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

30 SEPTEMBRE 2024

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	55,7
Obligations	39,5
Obligations	39,5
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,0
Fonds communs de placement	0,9
Fonds privés	0,5
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	52,5
Canada	11,6
Allemagne	5,9
Royaume-Uni	5,8
Autre	5,8
Japon	2,7
France	2,5
Irlande	1,9
Pays-Bas	1,9
Nouvelle-Zélande	1,8
Suisse	1,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Brésil	1,0
Mexique	1,0
Taiwan	0,9
Suède	0,8

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	22,6
Obligations de sociétés	14,9
Technologie de l'information	12,5
Services financiers	9,6
Soins de santé	7,3
Produits industriels	6,4
Consommation de base	5,1
Consommation discrétionnaire	4,4
Autre	3,5
Énergie	3,4
Matériaux	3,0
Services de communication	2,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,3
Services publics	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	1,0

31 MARS 2024

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Actions	55,7
Obligations	40,1
Obligations	36,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)	3,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)	–
Placements à court terme	1,6
Fonds/billets négociés en bourse	1,1
Fonds privés	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Fonds communs de placement	0,4
Options sur swaps achetées	–
Options sur devises achetées	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	52,9
Canada	10,4
Allemagne	5,8
Autre	5,3
Royaume-Uni	3,4
Mexique	3,2
France	3,1
Irlande	2,5
Japon	2,5
Nouvelle-Zélande	2,4
Brésil	2,3
Pays-Bas	2,1
Suisse	1,5
Danemark	1,1
Taiwan	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	20,2
Obligations de sociétés	15,5
Technologie de l'information	12,0
Services financiers	9,5
Soins de santé	7,9
Produits industriels	6,0
Consommation de base	4,9
Consommation discrétionnaire	4,7
Autre	4,4
Énergie	3,8
Matériaux	3,4
Services de communication	2,5
Obligations fédérales	1,9
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,6
Obligations provinciales	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES OPTIONS ACHETÉES

Au 30 septembre 2024

Élément sous-jacent	Nombre de contrats	Type d'option	Date d'échéance	Prix d'exercice \$	Prime payée (en milliers de \$)	Juste valeur (en milliers de \$)
Option de vente sur devises CAD/USD	15 321 000	Vente	21 mars 2025	1,36 USD	448	490
Option d'achat sur devises CAD/USD	18 384 000	Achat	22 juillet 2025	1,36 USD	538	356
<b>Total des options</b>					<b>986</b>	<b>846</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS

Au 30 septembre 2024

### Tableau des contrats à terme standardisés

Type de contrat	Nombre de contrats	Date d'échéance	Prix moyen des contrats (\$)	Montant notionnel* (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 10 ans, décembre 2024	(305)	18 décembre 2024	124,01 CAD	(38 128)	–	(302)
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain, décembre 2024	(95)	19 décembre 2024	134,56 USD	(17 099)	188	–
<b>Total des contrats à terme standardisés</b>				<b>(55 227)</b>	<b>188</b>	<b>(302)</b>

\* Le montant notionnel représente l'exposition aux instruments sous-jacents au 30 septembre 2024.

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	87 AUD	(59) USD	2 octobre 2024	80	81	1	–
A	61 USD	(87) AUD	2 octobre 2024	(82)	(82)	–	–
A	2 813 CAD	(2 089) USD	2 octobre 2024	(2 813)	(2 825)	–	(12)
A	2 082 USD	(2 813) CAD	2 octobre 2024	2 080	2 083	3	–
A	6 774 USD	(5 728) CHF	2 octobre 2024	(9 161)	(9 153)	8	–
A	5 728 CHF	(6 790) USD	2 octobre 2024	9 183	9 153	–	(30)
A	2 146 EUR	(2 379) USD	2 octobre 2024	3 217	3 232	15	–
A	2 395 USD	(2 146) EUR	2 octobre 2024	(3 239)	(3 232)	7	–
A	4 632 GBP	(6 089) USD	2 octobre 2024	8 235	8 378	143	–
A	6 213 USD	(4 632) GBP	2 octobre 2024	(8 402)	(8 378)	24	–
A	95 USD	(13 800) JPY	2 octobre 2024	(129)	(130)	–	(1)
A	13 800 JPY	(96) USD	2 octobre 2024	130	129	–	(1)
A	50 770 NOK	(4 796) USD	2 octobre 2024	6 486	6 506	20	–
A	4 820 USD	(50 770) NOK	2 octobre 2024	(6 519)	(6 506)	13	–
A	6 169 USD	(9 860) NZD	2 octobre 2024	(8 343)	(8 469)	–	(126)
A	9 860 NZD	(6 273) USD	2 octobre 2024	8 484	8 469	–	(15)
A	2 887 USD	(29 520) SEK	2 octobre 2024	(3 904)	(3 932)	–	(28)
A	29 520 SEK	(2 912) USD	2 octobre 2024	3 938	3 931	–	(7)
A	5 340 CAD	(3 910) USD	11 octobre 2024	(5 340)	(5 286)	54	–
A	47 058 CAD	(34 455) USD	11 octobre 2024	(47 058)	(46 586)	472	–
A	7 247 CAD	(5 257) USD	11 octobre 2024	(7 247)	(7 108)	139	–
A	23 068 CAD	(13 000) GBP	18 octobre 2024	(23 068)	(23 498)	–	(430)
A	615 CAD	(350) GBP	18 octobre 2024	(615)	(633)	–	(18)
A	7 224 CAD	(8 800) NZD	18 octobre 2024	(7 224)	(7 556)	–	(332)
A	16 500 NZD	(13 494) CAD	18 octobre 2024	13 494	14 169	675	–
A	86 730 CAD	(63 137) USD	18 octobre 2024	(86 730)	(85 351)	1 379	–
A	3 430 CAD	(2 496) USD	18 octobre 2024	(3 430)	(3 374)	56	–
A	67 025 CAD	(48 779) USD	18 octobre 2024	(67 025)	(65 943)	1 082	–
A	19 122 CAD	(12 810) EUR	25 octobre 2024	(19 122)	(19 296)	–	(174)
A	1 552 EUR	(2 328) CAD	25 octobre 2024	2 328	2 337	9	–
A	2 599 CAD	(38 367) MXN	25 octobre 2024	(2 599)	(2 623)	–	(24)
A	2 755 CAD	(40 523) MXN	25 octobre 2024	(2 755)	(2 771)	–	(16)
A	1 627 CAD	(23 910) MXN	25 octobre 2024	(1 627)	(1 635)	–	(8)
A	1 405 CAD	(20 695) MXN	25 octobre 2024	(1 405)	(1 415)	–	(10)
A	26 880 MXN	(1 855) CAD	25 octobre 2024	1 855	1 838	–	(17)
A	919 CAD	(674) USD	25 octobre 2024	(919)	(911)	8	–
A	11 776 CAD	(8 548) USD	25 octobre 2024	(11 776)	(11 555)	221	–
A	41 778 CAD	(30 325) USD	25 octobre 2024	(41 778)	(40 990)	788	–
A	8 419 CAD	(6 196) USD	25 octobre 2024	(8 419)	(8 375)	44	–

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## TABLEAU DES INSTRUMENTS DÉRIVÉS (suite)

Au 30 septembre 2024

### Tableau des contrats de change à terme de gré à gré (suite)

Note de crédit de la contrepartie	Devise à recevoir (en milliers de \$)	Devise à remettre (en milliers de \$)	Date de règlement	Coût du contrat (en milliers de \$)	Juste valeur actuelle (en milliers de \$)	Profits latents (en milliers de \$)	Pertes latentes (en milliers de \$)
A	17 974 CAD	(21 960) NZD	6 novembre 2024	(17 974)	(18 850)	–	(876)
A	26 362 CAD	(32 215) NZD	6 novembre 2024	(26 362)	(27 651)	–	(1 289)
A	351 AUD	(243) USD	6 novembre 2024	329	328	–	(1)
A	7 400 CAD	(5 482) USD	6 novembre 2024	(7 406)	(7 415)	–	(9)
A	9 895 USD	(8 314) CHF	6 novembre 2024	(13 381)	(13 345)	36	–
A	2 131 EUR	(2 382) USD	6 novembre 2024	3 221	3 213	–	(8)
A	4 779 GBP	(6 410) USD	6 novembre 2024	8 669	8 640	–	(29)
A	749 USD	(106 600) JPY	6 novembre 2024	(1 013)	(1 009)	4	–
A	15 710 NOK	(1 492) USD	6 novembre 2024	2 018	2 014	–	(4)
A	793 NZD	(504) USD	6 novembre 2024	682	681	–	(1)
A	7 560 SEK	(747) USD	6 novembre 2024	1 010	1 008	–	(2)
A	18 637 CAD	(13 525) USD	8 novembre 2024	(18 637)	(18 276)	361	–
A	6 316 CAD	(4 584) USD	8 novembre 2024	(6 316)	(6 195)	121	–
A	929 CAD	(674) USD	8 novembre 2024	(929)	(911)	18	–
A	15 727 CAD	(10 500) EUR	15 novembre 2024	(15 727)	(15 821)	–	(94)
A	8 483 CAD	(5 664) EUR	15 novembre 2024	(8 483)	(8 535)	–	(52)
A	1 149 CAD	(768) EUR	15 novembre 2024	(1 149)	(1 157)	–	(8)
A	23 808 CAD	(13 430) GBP	15 novembre 2024	(23 808)	(24 254)	–	(446)
A	20 427 CAD	(15 154) USD	15 novembre 2024	(20 427)	(20 473)	–	(46)
A	33 306 CAD	(24 706) USD	15 novembre 2024	(33 306)	(33 378)	–	(72)
A	18 852 CAD	(12 578) EUR	22 novembre 2024	(18 852)	(18 954)	–	(102)
A	29 852 CAD	(21 796) USD	22 novembre 2024	(29 852)	(29 441)	411	–
A	27 684 CAD	(20 396) USD	22 novembre 2024	(27 684)	(27 551)	133	–
A	28 528 CAD	(21 007) USD	22 novembre 2024	(28 528)	(28 376)	152	–
A	15 779 CAD	(11 630) USD	22 novembre 2024	(15 779)	(15 710)	69	–
<b>Total des contrats de change à terme de gré à gré</b>						<b>6 466</b>	<b>(4 288)</b>
<b>Total des actifs dérivés</b>							<b>6 654</b>
<b>Total des passifs dérivés</b>							<b>(4 590)</b>

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 1. Périodes comptables et renseignements généraux

L'information fournie dans les présents états financiers et dans les notes annexes se rapporte aux 30 septembre 2024 et 2023 ou aux semestres clos à ces dates, à l'exception des données comparatives présentées dans les états de la situation financière et les notes annexes, qui se rapportent au 31 mars 2024. Pour l'exercice au cours duquel un fonds ou une série est établi(e) ou rétabli(e), l'information fournie se rapporte à la période commençant à la date d'établissement ou de rétablissement. Lorsqu'une série d'un fonds a été dissoute au cours de l'une ou l'autre des périodes, l'information concernant la série est fournie jusqu'à la fermeture des bureaux à la date de dissolution. Se reporter à la note 10 a) pour la date de constitution du Fonds et la date d'établissement de chacune des séries.

Le Fonds a été constitué en fiducie de fonds commun de placement à capital variable en vertu des lois de la province de l'Ontario aux termes d'une déclaration de fiducie qui a été modifiée et mise à jour de temps à autre. Le siège social du Fonds est situé au 180, rue Queen Ouest, Toronto (Ontario) Canada. Le Fonds est autorisé à émettre un nombre illimité de parts (désignées en tant que « titre » ou « titres ») de séries multiples. Les séries du Fonds sont offertes à la vente aux termes d'un prospectus simplifié ou aux termes d'options de placement avec dispense de prospectus.

Corporation Financière Mackenzie (« Mackenzie ») est le gestionnaire du Fonds et appartient à cent pour cent à Société financière IGM Inc., filiale de Power Corporation du Canada. Gestion de placements Canada Vie limitée (« GPCV ») appartient à cent pour cent à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie (« Canada Vie »), filiale de Power Corporation du Canada. Les placements du Fonds dans des sociétés du groupe de sociétés Power sont identifiés dans le tableau des placements.

### 2. Base d'établissement et mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires non audités (les « états financiers ») ont été établis conformément aux normes IFRS de comptabilité (« IFRS »), y compris la Norme comptable internationale 34 (« IAS »), *Information financière intermédiaire*, telles qu'elles ont été publiées par l'International Accounting Standards Board (l'« IASB »). Ces états financiers ont été établis selon les mêmes méthodes comptables, les mêmes jugements comptables critiques et les mêmes estimations que ceux qui ont été utilisés pour établir les états financiers annuels audités les plus récents du Fonds, soit ceux de l'exercice clos le 31 mars 2024. La note 3 présente un résumé des méthodes comptables significatives du Fonds en vertu des IFRS.

Sauf indication contraire, tous les montants présentés dans ces états financiers sont en dollars canadiens, soit la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, et sont arrondis au millier près. Les états financiers ont été établis sur la base de la continuité d'exploitation au moyen de la méthode du coût historique, sauf dans le cas des instruments financiers qui ont été évalués à la juste valeur.

Les présents états financiers ont été approuvés aux fins de publication par le conseil d'administration de Corporation Financière Mackenzie le 12 novembre 2024.

### 3. Méthodes comptables significatives

#### a) Instruments financiers

Les instruments financiers comprennent des actifs financiers et des passifs financiers tels que des titres de créance, des titres de capitaux propres, des fonds d'investissement et des dérivés. Le Fonds classe et évalue ses instruments financiers conformément à l'IFRS 9, *Instruments financiers* (« IFRS 9 »). Au moment de la comptabilisation initiale, les instruments financiers sont classés comme étant à la juste valeur par le biais du résultat net (la « JVRN »). Tous les instruments financiers sont comptabilisés dans l'état de la situation financière lorsque le Fonds devient partie aux exigences contractuelles de l'instrument. Les actifs financiers sont décomptabilisés lorsque le droit de percevoir les flux de trésorerie liés aux instruments est échu ou que le Fonds a transféré la quasi-totalité des risques et avantages inhérents à la propriété de ceux-ci. Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque l'obligation est acquittée, est annulée ou expire. Les opérations d'achat et de vente de placements sont comptabilisées à la date de l'opération.

Les instruments financiers sont par la suite évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, et les variations de la juste valeur sont comptabilisées à l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

Le coût des placements est calculé en fonction d'un coût moyen pondéré.

Les profits et les pertes réalisé(e)s et latent(e)s sur les placements sont calculé(e)s en fonction du coût moyen pondéré des placements, mais excluent les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille, qui sont présentés de manière distincte dans l'état du résultat global au poste Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille.

Les profits et les pertes découlant de la variation de la juste valeur des placements sont pris en compte dans l'état du résultat global de la période au cours de laquelle ils surviennent.

Le Fonds comptabilise ses placements dans des fonds de placement à capital variable non cotés, des fonds privés (« Fonds sous-jacents ») et des fonds négociés en bourse (« FNB »), le cas échéant, à la juste valeur par le biais du résultat net. Pour les fonds privés, le gestionnaire aura recours aux évaluations fournies par les gestionnaires des fonds privés, ce qui représente la quote-part du Fonds de l'actif net de ces fonds privés. Les placements du Fonds dans des Fonds sous-jacents et des FNB, le cas échéant, sont présentés dans le tableau des placements à la juste valeur, ce qui représente l'exposition maximale du Fonds en lien avec ces placements.

Les titres rachetables du Fonds comportent de multiples obligations contractuelles différentes et confèrent aux porteurs de titres le droit de faire racheter leur participation dans le Fonds contre un montant de trésorerie égal à leur part proportionnelle de la valeur liquidative du Fonds, faisant en sorte qu'ils respectent le critère de classification à titre de passifs financiers, conformément à l'IAS 32 *Instruments financiers : Présentation*. L'obligation du Fonds à l'égard de l'actif net attribuable aux porteurs de titres est présentée au prix de rachat.

L'IAS 7, *Tableau des flux de trésorerie*, exige la présentation d'information relative aux changements dans les passifs et les actifs, comme les titres du Fonds, découlant d'activités de financement. Les changements relatifs aux titres du Fonds, y compris les changements découlant des flux de trésorerie et les changements sans effet de trésorerie, sont inclus à l'état de l'évolution de la situation financière. Tout changement relatif aux titres non réglé en espèces à la fin de la période est présenté à titre de Sommes à recevoir pour titres émis ou de Sommes à payer pour titres rachetés à l'état de la situation financière. Ces sommes à recevoir et à payer sont normalement réglées peu après la fin de la période.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur

La juste valeur est définie comme le prix qui serait obtenu à la vente d'un actif ou qui serait payé au transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation.

Les placements dans des titres cotés à une Bourse des valeurs mobilières ou négociés sur un marché hors cote, y compris les FNB, sont évalués selon le dernier cours de marché ou le cours de clôture enregistré par la Bourse sur laquelle le titre se négocie principalement, le cours se situant à l'intérieur d'un écart acheteur-vendeur pour le placement. Dans certaines circonstances, lorsque le cours ne se situe pas à l'intérieur de l'écart acheteur-vendeur, Mackenzie détermine le point le plus représentatif de la juste valeur dans cet écart en fonction de faits et de circonstances spécifiques. Les titres de fonds communs d'un fonds sous-jacent sont évalués un jour ouvrable au cours calculé par le gestionnaire de ce fonds sous-jacent, conformément à ses actes constitutifs. Les titres non cotés ou non négociés à une Bourse et les titres dont le cours de la dernière vente ou de clôture n'est pas disponible ou les titres pour lesquels les cours boursiers, de l'avis de Mackenzie, sont inexacts ou incertains, ou ne reflètent pas tous les renseignements significatifs disponibles, sont évalués à leur juste valeur, laquelle sera déterminée par Mackenzie à l'aide de techniques d'évaluation appropriées et acceptées par le secteur, y compris des modèles d'évaluation. La juste valeur d'un titre déterminée à l'aide de modèles d'évaluation exige l'utilisation de facteurs et d'hypothèses fondés sur les données observables sur le marché, notamment la volatilité et les autres taux ou prix applicables. Dans des cas limités, la juste valeur d'un titre peut être déterminée grâce à des techniques d'évaluation qui ne sont pas appuyées par des données observables sur le marché.

La trésorerie et les équivalents de trésorerie, qui incluent les dépôts de trésorerie auprès d'institutions financières et les placements à court terme qui sont facilement convertibles en trésorerie, sont soumis à un risque négligeable de changement de valeur et sont utilisés par le Fonds dans la gestion de ses engagements à court terme. La trésorerie, les équivalents de trésorerie et les placements à court terme sont présentés à leur juste valeur, qui se rapproche de leur coût amorti en raison de leur nature très liquide et de leur échéance à court terme. Les découverts bancaires sont présentés dans les passifs courants à titre de dette bancaire dans l'état de la situation financière. Les placements à court terme qui ne sont pas considérés comme des équivalents de trésorerie sont présentés séparément dans le tableau des placements.

Le Fonds peut avoir recours à des instruments dérivés (comme les options souscrites, les contrats à terme standardisés ou de gré à gré, les swaps ou les instruments dérivés sur mesure) en guise de couverture contre les pertes occasionnées par des fluctuations des cours des titres, des taux d'intérêt ou des taux de change. Le Fonds peut également avoir recours à des instruments dérivés à des fins autres que de couverture afin d'effectuer indirectement des placements dans des titres ou des marchés financiers, de s'exposer à d'autres devises, de chercher à générer des revenus supplémentaires ou à toute autre fin considérée comme appropriée par le ou les portefeuillistes du Fonds, pourvu que cela soit compatible avec les objectifs de placement du Fonds. Les instruments dérivés doivent être utilisés conformément à la législation canadienne sur les organismes de placement collectif, sous réserve des dispenses accordées au Fonds par les organismes de réglementation, le cas échéant.

L'évaluation des instruments dérivés est effectuée quotidiennement, au moyen des sources usuelles d'information provenant des Bourses pour les instruments dérivés cotés en Bourse et des demandes précises auprès des courtiers relativement aux instruments dérivés hors cote.

La valeur des contrats à terme de gré à gré représente le profit ou la perte qui serait réalisé(e) si, à la date d'évaluation, les positions détenues étaient dénouées. La variation de la valeur des contrats à terme de gré à gré est incluse dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) latent(e).

La fluctuation quotidienne de la valeur des contrats à terme standardisés ou des swaps, de même que les règlements au comptant effectués tous les jours par le Fonds, le cas échéant, représentent la variation des profits ou des pertes latent(e)s, mieux établi(e)s au prix de règlement. Ces profits ou pertes latent(e)s sont inscrit(e)s et comptabilisé(e)s de cette manière jusqu'à ce que le Fonds dénoue le contrat ou que le contrat arrive à échéance. La marge versée ou reçue au titre des contrats à terme standardisés ou des swaps figure en tant que créance dans l'état de la situation financière au poste Marge sur instruments dérivés. Toute modification de l'exigence en matière de marge est rajustée quotidiennement.

Les primes payées pour l'achat d'options sont comptabilisées dans l'état de la situation financière au poste Placements à la juste valeur.

Les primes reçues à la souscription d'options sont incluses dans l'état de la situation financière à titre de passif et sont par la suite ajustées quotidiennement à leur juste valeur. Si une option souscrite vient à échéance sans avoir été exercée, la prime reçue est inscrite à titre de profit réalisé. Lorsqu'une option d'achat souscrite est exercée, l'écart entre le produit de la vente plus la valeur de la prime et le coût du titre est inscrit à titre de profit ou de perte réalisé(e). Lorsqu'une option de vente souscrite est exercée, le coût du titre acquis correspond au prix d'exercice de l'option moins la prime reçue.

Se reporter au tableau des instruments dérivés et au tableau des options achetées/vendues, le cas échéant, compris dans le tableau des placements pour la liste des instruments dérivés et des options au 30 septembre 2024.

Le Fonds classe la juste valeur de ses actifs et de ses passifs en trois catégories, lesquelles se différencient en fonction de la nature des données, observables ou non, et de la portée de l'estimation requise.

Niveau 1 – Prix non rajustés cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques;

Niveau 2 – Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, soit directement, soit indirectement. Les évaluations de niveau 2 comprennent, par exemple, des prix cotés pour des titres semblables, des prix cotés sur des marchés inactifs et provenant de courtiers en valeurs mobilières reconnus, ainsi que l'application à des prix cotés ailleurs qu'en Amérique du Nord de facteurs obtenus à partir de données observables dans le but d'estimer l'incidence que peuvent avoir les différentes heures de clôture des marchés.

Les instruments financiers classés au niveau 2 sont évalués en fonction des prix fournis par une entreprise d'évaluation indépendante et reconnue qui établit le prix des titres en se fondant sur les opérations récentes et sur les estimations obtenues des intervenants du marché, en incorporant des données de marché observables et en ayant recours à des pratiques standards sur les marchés. Les placements à court terme classés au niveau 2 sont évalués en fonction du coût amorti, majoré des intérêts courus, ce qui se rapproche de la juste valeur.

Les justes valeurs estimées pour ces titres pourraient être différentes des valeurs qui auraient été utilisées si un marché pour le placement avait existé;

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### b) Évaluation de la juste valeur (suite)

Niveau 3 – Données qui ne sont pas fondées sur des données de marché observables.

Les données sont considérées comme observables si elles sont élaborées à l'aide de données de marché, par exemple les informations publiées sur des événements ou des transactions réels, qui reflètent les hypothèses que les intervenants du marché utiliseraient pour fixer le prix de l'actif ou du passif.

Voir la note 10 pour le classement des justes valeurs du Fonds.

#### c) Comptabilisation des produits

Les revenus d'intérêts aux fins de distribution correspondent à l'intérêt nominal reçu par le Fonds et sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'engagement. Le Fonds n'amortit pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe, à l'exception des obligations à coupon zéro, qui sont amorties selon le mode linéaire. Les dividendes sont cumulés à compter de la date ex-dividende. Les profits ou les pertes latent(e)s sur les placements, les profits ou pertes réalisé(e)s à la vente de placements, lesquels comprennent les profits ou pertes de change sur ces placements, sont établis selon la méthode du coût moyen pondéré. Les distributions reçues d'un fonds sous-jacent sont comprises dans les revenus d'intérêts ou de dividendes, dans le profit (la perte) réalisé(e) à la vente de placements ou dans le revenu provenant des rabais sur les frais, selon le cas, à la date ex-dividende ou de distribution.

Le revenu, les profits (pertes) réalisé(e)s et les profits (pertes) latent(e)s sont répartis quotidiennement et proportionnellement entre les séries.

#### d) Commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille

Les commissions et autres coûts d'opérations de portefeuille sont des charges engagées en vue d'acquérir, d'émettre ou de céder des actifs financiers ou des passifs financiers. Ils comprennent les honoraires et les commissions versés aux agents, aux bourses, aux courtiers et aux autres intermédiaires. Tous les courtages engagés par le Fonds en lien avec les opérations de portefeuille pour les périodes, ainsi que les autres frais d'opérations, sont présentés dans les états du résultat global. Les activités de courtage sont attribuées aux courtiers en fonction du meilleur résultat net pour le Fonds. Sous réserve de ces critères, des commissions peuvent être versées à des sociétés de courtage qui offrent certains services (ou les paient), outre l'exécution des ordres, y compris la recherche, l'analyse et les rapports sur les placements, et les bases de données et les logiciels à l'appui de ces services. Le cas échéant et lorsqu'elle est vérifiable, la valeur de ces services fournis au cours des périodes est présentée à la note 10. La valeur de certains services exclusifs fournis par des courtiers ne peut être estimée raisonnablement.

#### e) Opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres

Le Fonds est autorisé à effectuer des opérations de prêt, de mise en pension et de prise en pension de titres, tel qu'il est défini dans le prospectus simplifié du Fonds. Ces opérations s'effectuent par l'échange temporaire de titres contre des biens donnés en garantie comportant l'engagement de rendre les mêmes titres à une date ultérieure.

Le revenu tiré de ces opérations se présente sous forme de frais réglés par la contrepartie et, dans certains cas, sous forme d'intérêts sur la trésorerie ou les titres détenus en garantie. Le revenu tiré de ces opérations est présenté à l'état du résultat global et constaté lorsqu'il est gagné. Les opérations de prêts de titres sont gérées par The Bank of New York Mellon (l'« agent de prêt de titres »). La valeur de la trésorerie ou des titres détenus en garantie doit équivaloir à au moins 102 % de la juste valeur des titres prêtés, vendus ou achetés.

La note 10 résume les détails relatifs aux titres prêtés et aux biens reçus en garantie à la fin de la période, et présente un rapprochement des revenus de prêt de titres durant la période, le cas échéant. Les biens reçus en garantie se composent de titres de créance du gouvernement du Canada et d'autres pays, d'administrations municipales, de gouvernements provinciaux et d'institutions financières du Canada.

#### f) Compensation

Les actifs financiers et les passifs financiers sont compensés et le solde net est comptabilisé dans l'état de la situation financière seulement s'il existe un droit exécutoire de compenser les montants comptabilisés et qu'il y a intention soit de régler le montant net, soit de réaliser l'actif et de régler le passif simultanément. Dans le cours normal des activités, le Fonds conclut diverses conventions-cadres de compensation ou ententes similaires qui ne satisfont pas aux critères de compensation dans l'état de la situation financière, mais qui permettent tout de même de compenser les montants dans certaines circonstances, comme une faillite ou une résiliation de contrat. La note 10 résume les détails de la compensation, le cas échéant, qui fait l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière si la totalité des droits à compensation était exercée.

Les produits et les charges ne sont pas compensés à l'état du résultat global, à moins qu'une norme comptable présentée de manière spécifique dans les méthodes IFRS adoptées par le Fonds l'exige ou le permette.

#### g) Devise

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds. Les achats et les ventes de placements en devises ainsi que les dividendes, le revenu d'intérêts et les charges d'intérêts en devises sont convertis en dollars canadiens au taux de change en vigueur au moment de l'opération.

Les profits (pertes) de change à l'achat ou à la vente de devises sont comptabilisé(e)s dans l'état du résultat global au poste Autres variations de la juste valeur des placements et autres actifs nets – Profit (perte) net(te) réalisé(e).

La juste valeur des placements ainsi que des autres actifs et passifs libellés en devises est convertie en dollars canadiens au taux de change en vigueur chaque jour ouvrable.

#### h) Actif net attribuable aux porteurs de titres, par titre

L'actif net attribuable aux porteurs de titres par titre est calculé en divisant l'actif net attribuable aux porteurs de titres d'une série de titres un jour ouvrable donné par le nombre total de titres de la série en circulation ce jour-là.

#### i) Valeur liquidative par titre

La valeur liquidative quotidienne d'un fonds d'investissement peut être calculée sans tenir compte des IFRS conformément aux règlements des Autorités canadiennes en valeurs mobilières (les « ACVM »). La différence entre la valeur liquidative et l'actif net attribuable aux porteurs de titres (tel qu'il est présenté dans les états financiers), le cas échéant, tient principalement aux différences liées à la juste valeur des placements et des autres actifs financiers et passifs financiers, et est présentée à la note 10, le cas échéant.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 3. Méthodes comptables significatives (suite)

#### j) Augmentation (diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation, par titre

L'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation par titre figurant dans l'état du résultat global représente l'augmentation (la diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs de titres liée aux activités d'exploitation pour la période, divisée par le nombre moyen pondéré de titres en circulation au cours de la période.

#### k) Fusions

Dans le cadre d'une fusion de fonds, le Fonds fait l'acquisition de tous les actifs et prend en charge la totalité du passif du fonds dissous à la juste valeur en échange des titres du Fonds à la date de prise d'effet de la fusion.

#### l) Modifications comptables futures

Le Fonds a déterminé qu'aucune incidence significative sur ses états financiers ne découle des IFRS publiées mais non encore en vigueur.

### 4. Estimations et jugements comptables critiques

L'établissement de ces états financiers exige de la direction qu'elle fasse des estimations et qu'elle pose des hypothèses ayant principalement une incidence sur l'évaluation des placements. Les estimations et les hypothèses sont révisées de façon continue. Les résultats réels peuvent différer de ces estimations.

Voici les estimations et les jugements comptables les plus importants utilisés pour établir les états financiers :

#### Utilisation d'estimations

##### *Juste valeur des titres non cotés sur un marché actif*

Le Fonds peut détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur un marché actif et qui sont évalués au moyen de techniques d'évaluation fondées sur des données observables, dans la mesure du possible. Diverses techniques d'évaluation sont utilisées, selon un certain nombre de facteurs, notamment la comparaison avec des instruments similaires pour lesquels des cours du marché observables existent et l'examen de transactions récentes réalisées dans des conditions de concurrence normale. Les données d'entrée et les hypothèses clés utilisées sont propres à chaque société et peuvent comprendre les taux d'actualisation estimés et la volatilité prévue des prix. Des changements de données d'entrée clés peuvent entraîner une variation de la juste valeur présentée pour ces instruments financiers détenus par le Fonds.

#### Utilisation de jugements

##### *Classement et évaluation des placements*

Lors du classement et de l'évaluation des instruments financiers détenus par le Fonds, Mackenzie doit exercer des jugements importants afin de déterminer le classement le plus approprié selon l'IFRS 9. Mackenzie a évalué le modèle économique du Fonds, sa façon de gérer l'ensemble des instruments financiers ainsi que sa performance globale sur la base de la juste valeur, et elle a conclu que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net conformément à l'IFRS 9 constitue la méthode d'évaluation et de présentation la plus appropriée pour les instruments financiers du Fonds.

##### *Monnaie fonctionnelle*

Le dollar canadien est la monnaie fonctionnelle et la monnaie de présentation du Fonds, étant considéré comme la monnaie qui représente le plus fidèlement les effets économiques des opérations, événements et conditions sous-jacents du Fonds, compte tenu de la manière dont les titres sont émis et rachetés et dont le rendement et la performance du Fonds sont évalués.

##### *Intérêts dans des entités structurées non consolidées*

Afin de déterminer si un Fonds sous-jacent ou un FNB dans lequel le Fonds investit, mais qu'il ne consolide pas, respecte la définition d'une entité structurée, Mackenzie doit exercer des jugements importants visant à établir si ces fonds sous-jacents possèdent les caractéristiques typiques d'une entité structurée. Ces Fonds sous-jacents respectent la définition d'une entité structurée, car :

- I. les droits de vote dans les Fonds sous-jacents ne sont pas des facteurs dominants pour décider qui les contrôle;
- II. les activités des Fonds sous-jacents sont assujetties à des restrictions aux termes de leurs documents de placement;
- III. les Fonds sous-jacents ont des objectifs de placement précis et bien définis visant à offrir des occasions de placement aux investisseurs tout en leur transférant les risques et avantages connexes.

Par conséquent, de tels placements sont comptabilisés à la JVRN. La note 10 résume les détails des participations du Fonds dans ces Fonds sous-jacents, le cas échéant.

### 5. Impôts sur le résultat

Le Fonds est admissible à titre de fiduciaire de fonds commun de placement en vertu des dispositions de la *Loi de l'impôt sur le revenu (Canada)*. Par conséquent, il est assujéti à l'impôt pour ce qui est de ses bénéficiaires, y compris le montant net des gains en capital réalisés pour l'année d'imposition, qui ne sont ni payés ni à payer à ses porteurs de titres à la fin de l'année d'imposition. La fin de l'année d'imposition du Fonds est en décembre. Le Fonds peut être assujéti aux retenues à la source d'impôts étrangers. En général, le Fonds traite les retenues d'impôts à la source en tant que charges portées en réduction du bénéfice aux fins du calcul de l'impôt. Le Fonds distribuera des montants suffisants tirés de son bénéfice net aux fins du calcul de l'impôt, au besoin, afin de ne pas payer d'impôt sur le résultat, à l'exception des impôts remboursables sur les gains en capital, le cas échéant.

Les pertes du Fonds ne peuvent être attribuées aux investisseurs et sont conservées par le Fonds pour des exercices futurs. Les pertes autres qu'en capital peuvent être reportées prospectivement jusqu'à 20 ans afin de réduire le bénéfice imposable et les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Les pertes en capital peuvent être reportées prospectivement indéfiniment afin de réduire les gains en capital réalisés au cours d'exercices futurs. Se reporter à la note 10 pour les reports prospectifs de pertes fiscales du Fonds.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 6. Frais de gestion et frais d'exploitation

Mackenzie reçoit des frais de gestion pour la gestion du portefeuille de placements, l'analyse des placements, la formulation de recommandations et la prise de décisions quant aux placements, ainsi que pour la prise de dispositions de courtage pour l'achat et la vente de titres en portefeuille et la conclusion d'ententes avec des courtiers inscrits pour l'achat et la vente de titres du Fonds par des investisseurs. Les frais de gestion sont calculés pour chaque série de titres du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

Chaque série du Fonds, exception faite de la série-B, se voit imputer des frais d'administration annuels à taux fixe (les « frais d'administration ») et en retour, Mackenzie prend en charge tous les frais d'exploitation du Fonds autres que certains frais précis associés au Fonds. Les frais d'administration sont calculés pour chaque série de titres du Fonds en tant que pourcentage annuel fixe de la valeur liquidative quotidienne de la série.

Les autres frais associés au Fonds comprennent les taxes et impôts (y compris, mais sans s'y limiter, la TPS/TVH et l'impôt sur le résultat), les intérêts et les coûts d'emprunt, l'ensemble des frais et charges du Comité d'examen indépendant (« CEI ») des Fonds Mackenzie, les charges engagées pour respecter les exigences réglementaires en matière de production des Aperçus du Fonds, les frais versés à des fournisseurs de services externes en lien avec le recouvrement ou le remboursement de l'impôt ou avec la préparation de déclarations de revenus à l'étranger pour le compte du Fonds, les nouveaux frais associés aux services externes qui n'étaient pas généralement facturés dans le secteur canadien des fonds communs de placement et qui sont entrés en vigueur après la date de dépôt du prospectus simplifié le plus récent, ainsi que les coûts engagés pour respecter les nouvelles exigences réglementaires, y compris, sans s'y limiter, tous les nouveaux frais en vigueur après la date de dépôt du prospectus simplifié le plus récent.

Tous les frais associés à l'exploitation du Fonds quant aux titres de la série-B seront imputés à cette série. Les frais d'exploitation comprennent les frais juridiques, honoraires d'audit, frais de l'agent des transferts, droits de garde, frais d'administration et de fiducie, le coût des rapports financiers et d'impression des prospectus simplifiés, les droits de dépôt obligatoire, les autres charges diverses imputables précisément aux titres de série-B et tout impôt ou taxe applicable.

Mackenzie peut renoncer aux frais de gestion et d'administration ou les absorber à son gré et mettre fin à la renonciation ou à l'absorption de ces frais en tout temps, sans préavis. Se reporter à la note 10 pour les taux des frais de gestion et d'administration imputés à chaque série de titres.

### 7. Capital du Fonds

Le capital du Fonds, qui comprend l'actif net attribuable aux porteurs de titres, est réparti entre les différentes séries, lesquelles comportent chacune un nombre illimité de titres. Les titres en circulation du Fonds aux 30 septembre 2024 et 2023 ainsi que les titres qui ont été émis, réinvestis et rachetés au cours de ces périodes sont présentés dans l'état de l'évolution de la situation financière. Mackenzie gère le capital du Fonds conformément aux objectifs de placement décrits à la note 10.

### 8. Risques découlant des instruments financiers

#### i. Exposition au risque et gestion du risque

Les activités de placement du Fonds l'exposent à divers risques financiers, tels qu'ils sont définis dans l'IFRS 7, *Instruments financiers : Informations à fournir* (« IFRS 7 »). L'exposition du Fonds aux risques financiers est concentrée dans ses placements, lesquels sont présentés dans le tableau des placements au 30 septembre 2024, regroupés par type d'actif, région géographique et secteur.

Mackenzie cherche à atténuer les éventuelles répercussions néfastes de ces risques sur le rendement du Fonds par l'embauche de conseillers en portefeuille professionnels et expérimentés, par la surveillance quotidienne des positions du Fonds et des événements du marché ainsi que par la diversification du portefeuille de placements en respectant les contraintes des objectifs de placement du Fonds; elle peut aussi, le cas échéant, avoir recours à des instruments dérivés à titre de couverture de certains risques. Pour faciliter la gestion des risques, Mackenzie maintient également une structure de gouvernance, dont le rôle consiste à superviser les activités de placement du Fonds et à s'assurer de la conformité avec la stratégie de placement établie du Fonds, les directives internes et la réglementation des valeurs mobilières.

#### ii. Risque de liquidité

Le risque de liquidité est le risque que le Fonds éprouve des difficultés à respecter ses obligations financières au fur et à mesure que celles-ci deviennent exigibles. Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats potentiels quotidiens en espèces de titres rachetables. Pour surveiller la liquidité de ses actifs, le Fonds a recours à un programme de gestion du risque de liquidité permettant de calculer le nombre de jours nécessaires pour convertir les placements détenus par le Fonds en espèces au moyen d'une approche de liquidation sur plusieurs jours. Cette analyse du risque de liquidité évalue la liquidité du Fonds en fonction de pourcentages de liquidité minimale prédéterminés établis pour diverses périodes et est surveillée sur une base trimestrielle. En outre, le Fonds peut emprunter jusqu'à concurrence de 5 % de la valeur de son actif net pour financer ses rachats.

Pour se conformer à la réglementation sur les valeurs mobilières, le Fonds doit conserver au moins 85 % de son actif dans des placements liquides (c.-à-d. des placements pouvant être facilement vendus).

#### iii. Risque de change

Le risque de change est le risque que les instruments financiers libellés ou échangés dans une monnaie autre que le dollar canadien, qui est la monnaie fonctionnelle du Fonds, fluctuent en raison de variations des taux de change. En règle générale, la valeur des placements libellés dans une devise augmente lorsque la valeur du dollar canadien baisse (par rapport aux devises). À l'inverse, lorsque la valeur du dollar canadien augmente par rapport aux devises, la valeur des placements libellés dans une devise baisse.

La note 10 indique les devises, le cas échéant, auxquelles le Fonds avait une exposition importante, tant pour les instruments financiers monétaires que non monétaires, et illustre l'incidence potentielle, en dollars canadiens, sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 5 % du dollar canadien relativement à toutes les devises, toute autre variable demeurant constante. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être significatif.

La sensibilité du Fonds au risque de change présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés, y compris les contrats de change à terme de gré à gré. Les autres actifs financiers et passifs financiers (y compris les dividendes et les intérêts à recevoir, ainsi que les sommes à recevoir ou à payer pour les placements vendus ou achetés) libellés en devises n'exposent pas le Fonds à un risque de change important.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 8. Risques découlant des instruments financiers (suite)

#### iv. Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est lié aux instruments financiers portant intérêt. Le Fonds est exposé au risque que la valeur des instruments financiers portant intérêt fluctue selon les variations des taux d'intérêt du marché en vigueur. En règle générale, la valeur de ces titres augmente lorsque les taux d'intérêt baissent et diminue lorsqu'ils augmentent.

Si l'exposition est importante, la note 10 résume les instruments financiers portant intérêt du Fonds selon la durée résiduelle jusqu'à l'échéance et illustre l'incidence potentielle sur l'actif net du Fonds d'une hausse ou d'une baisse de 1 % des taux d'intérêt en vigueur, la courbe des taux évoluant en parallèle et toute autre variable demeurant constante. La sensibilité du Fonds aux fluctuations des taux d'intérêt a été estimée au moyen de la duration moyenne pondérée. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être significatif.

La sensibilité du Fonds au risque de taux d'intérêt présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés. La trésorerie et les équivalents de trésorerie ainsi que les autres instruments du marché monétaire sont à court terme et ne sont généralement pas exposés à un risque de taux d'intérêt impliquant des montants importants.

#### v. Autre risque de prix

L'autre risque de prix est le risque que la valeur des instruments financiers fluctue en fonction des variations des cours du marché (autres que celles découlant du risque de taux d'intérêt ou du risque de change), que ces variations découlent de facteurs propres à un placement individuel ou à son émetteur, ou d'autres facteurs ayant une incidence sur tous les instruments négociés sur un marché ou un segment du marché. Tous les placements présentent un risque de perte en capital. Ce risque est géré grâce à une sélection minutieuse de placements et d'autres instruments financiers conformes aux stratégies de placement. À l'exception de certains contrats dérivés, le risque maximal découlant des instruments financiers équivaut à leur juste valeur. Le risque maximal de perte sur certains contrats dérivés, comme des contrats à terme de gré à gré, des swaps ou des contrats à terme standardisés équivaut à leurs montants notionnels. Dans le cas d'options d'achat (de vente) et de positions vendeur sur contrats à terme standardisés, la perte pour le Fonds continue d'augmenter, théoriquement sans limite, au fur et à mesure que la juste valeur de l'élément sous-jacent augmente (diminue). Toutefois, ces instruments sont généralement utilisés dans le cadre du processus global de gestion des placements afin de gérer le risque provenant des placements sous-jacents et n'augmentent généralement pas le risque de perte global du Fonds. Pour atténuer ce risque, le Fonds s'assure de détenir à la fois l'élément sous-jacent, la couverture en espèces ou la marge, dont la valeur équivaut à celle du contrat dérivé ou lui est supérieure.

L'autre risque de prix découle habituellement de l'exposition aux titres de participation et aux titres liés aux marchandises. Si l'exposition est importante, la note 10 illustre l'augmentation ou la diminution possible de l'actif net du Fonds si les cours des Bourses où se négocient ces titres avaient augmenté ou diminué de 10 %, toute autre variable demeurant constante. En pratique, les résultats réels de négociation peuvent différer et l'écart pourrait être significatif.

La sensibilité du Fonds à l'autre risque de prix présentée à la note 10 comprend l'incidence indirecte potentielle des fonds sous-jacents et des FNB dans lesquels investit le Fonds, et/ou des contrats d'instruments dérivés.

#### vi. Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une contrepartie à un instrument financier ne s'acquitte pas d'une obligation ou d'un engagement pris envers le Fonds. La note 10 résume l'exposition du Fonds au risque de crédit, si une telle exposition s'applique et est importante.

Si elles sont présentées, les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée. L'exposition indirecte au risque de crédit peut provenir des titres à revenu fixe, tels que les obligations, détenus par des fonds sous-jacents ou des FNB, le cas échéant. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres.

Afin de réduire la possibilité d'un défaut de règlement, la livraison des titres vendus se fait simultanément contre paiement, quand les pratiques du marché le permettent, au moyen d'un dépôt central ou d'une agence de compensation et de dépôt lorsque c'est la façon de procéder.

La valeur comptable des placements et des autres actifs représente l'exposition maximale au risque de crédit à la date de l'état de la situation financière. Le Fonds peut effectuer des opérations de prêt sur titres avec d'autres parties et peut aussi être exposé au risque de crédit découlant des contreparties aux instruments dérivés qu'il pourrait utiliser. Le risque de crédit associé à ces opérations est jugé minime puisque toutes les contreparties ont une cote de solvabilité équivalant à une note de crédit d'une agence de notation désignée d'au moins A-1 (faible) pour la dette à court terme ou de A pour la dette à long terme, selon le cas.

#### vii. Fonds sous-jacents

Le Fonds peut investir dans des fonds sous-jacents et peut être exposé indirectement au risque de change, au risque de taux d'intérêt, à l'autre risque de prix et au risque de crédit en raison des fluctuations de la valeur des instruments financiers détenus par les fonds sous-jacents. La note 10 résume l'exposition du Fonds à ces risques provenant des fonds sous-jacents, si une telle exposition s'applique et est importante.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 9. Autres informations

#### Abréviations

Les devises, le cas échéant, sont présentées dans les présents états financiers en utilisant les codes de devises suivants :

Code de la devise	Description	Code de la devise	Description	Code de la devise	Description
AUD	Dollar australien	HUF	Forint hongrois	PLN	Zloty polonais
AED	Dirham des Émirats arabes unis	IDR	Rupiah indonésienne	QAR	Rial du Qatar
BRL	Real brésilien	ILS	Shekel israélien	RON	Leu roumain
CAD	Dollar canadien	INR	Roupie indienne	RUB	Rouble russe
CHF	Franc suisse	JPY	Yen japonais	SAR	Riyal saoudien
CZK	Couronne tchèque	KOR	Won sud-coréen	SEK	Couronne suédoise
CLP	Peso chilien	MXN	Peso mexicain	SGD	Dollar de Singapour
CNY	Yuan chinois	MYR	Ringgit malaisien	THB	Baht thaïlandais
COP	Peso colombien	NGN	Naira nigérian	TRL	Livre turque
DKK	Couronne danoise	NOK	Couronne norvégienne	USD	Dollar américain
EGP	Livre égyptienne	NTD	Nouveau dollar de Taïwan	VND	Dong vietnamien
EUR	Euro	NZD	Dollar néo-zélandais	ZAR	Rand sud-africain
GBP	Livre sterling	PEN	Nouveau sol péruvien	ZMW	Kwacha zambien
GHS	Cedi ghanéen	PHP	Peso philippin		
HKD	Dollar de Hong Kong	PKR	Roupie pakistanaise		

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a))

#### a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries

Date de constitution : 29 septembre 2006

Le Fonds peut émettre un nombre illimité de titres de chaque série. Le nombre de titres de chaque série qui ont été émis et qui sont en circulation est présenté dans les états de l'évolution de la situation financière.

**Séries offertes par Corporation Financière Mackenzie (180, rue Queen Ouest, Toronto (Ontario) M5V 3K1; 1-800-387-0615; [www.placementsmackenzie.com](http://www.placementsmackenzie.com))**

Les titres des séries A, T5 et T8 sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour les séries T5 et T8). Les investisseurs des séries A et T5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année, et les investisseurs de série T8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

Les titres de série AR sont offerts aux particuliers dans un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie.

Les titres de série D sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$ par l'entremise d'un compte de courtage à escompte ou de tout autre compte approuvé par Mackenzie. Les investisseurs de série D désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries F et F8 sont offerts aux investisseurs qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte ou de comptes intégrés parrainé par le courtier, qui sont assujettis à des frais établis en fonction de l'actif plutôt qu'à des commissions pour chaque opération et qui investissent un minimum de 500 \$ (5 000 \$ pour la série F8); ils sont également proposés aux employés de Mackenzie et de ses filiales, et aux administrateurs de Mackenzie. Les investisseurs des séries F et F8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série FB sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série FB désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries O et O5 sont offerts seulement aux investisseurs qui investissent un minimum de 500 000 \$ et qui participent au Service d'architecture de portefeuille ou au Service d'architecture ouverte de Mackenzie; ils sont également proposés à certains investisseurs institutionnels, à certains investisseurs d'un régime collectif admissible et à certains employés admissibles de Mackenzie et de ses filiales. Les investisseurs des séries O et O5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres des séries PW, PWT5 et PWT8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs des séries PW et PWT5 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année. Les investisseurs de série PWT8 désirent recevoir un flux de revenu mensuel de 8 % par année.

Les titres de série PWFB sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs de série PWFB désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % par année.

Les titres de série PWR sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$ dans un régime enregistré d'épargne-invalidité offert par Mackenzie.

Les titres des séries PWX et PWX8 sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée de nos Solutions Patrimoine privé qui investissent un minimum de 100 000 \$. Les investisseurs doivent négocier leurs honoraires de service du conseiller, lesquels ne peuvent dépasser 1,50 %, avec leur conseiller financier. Les investisseurs des séries PWX et PWX8 désirent également recevoir un flux de revenu mensuel de 5 % ou de 8 % par année, respectivement.

Les titres de série R sont offerts exclusivement à d'autres fonds gérés par Mackenzie et non visés par un prospectus relativement à des ententes de fonds de fonds.

Les titres de série S sont offerts à La Compagnie d'Assurance du Canada sur la Vie et à certains autres fonds communs de placement, mais peuvent être vendus à d'autres investisseurs comme le déterminera Mackenzie.

Les titres des séries B, GF, GF8, GLF, GO, GPW, GPWFB, GPWT8, GPWX, GPWX8, GW et OJ ont été créés exclusivement afin de mettre en œuvre les fusions touchant le Fonds et ne sont pas offerts à la vente.

Les titres des séries G et I ne sont plus offerts à la vente.

**Séries distribuées par BLC Services Financiers inc. (1360, boul. René-Lévesque Ouest, 13<sup>e</sup> étage, Montréal (Québec) H3G 0A9; 1-800-252-1846; [www.banquelaurentienne.ca/mackenzie](http://www.banquelaurentienne.ca/mackenzie))**

Les titres de série LB sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$.

Les titres de série LF sont offerts aux particuliers qui investissent un minimum de 500 \$, qui participent à un programme de services rémunérés à l'acte parrainé par Gestion privée Banque Laurentienne.

Les titres de série LW sont offerts à certains investisseurs à valeur nette élevée du programme de tarification préférentielle qui investissent un minimum de 100 000 \$.

Depuis le 1<sup>er</sup> juin 2022, les investisseurs peuvent acheter des titres du Fonds seulement en vertu d'un mode de souscription avec frais d'acquisition. Les frais d'acquisition du mode de souscription avec frais d'acquisition sont négociés entre l'investisseur et son courtier. Les titres souscrits avant le 1<sup>er</sup> juin 2022 en vertu du mode de souscription avec frais de rachat et du mode de souscription avec frais modérés 3 (collectivement, les « modes de souscription avec frais d'acquisition différés ») peuvent continuer d'être détenus dans les comptes des investisseurs. Les investisseurs peuvent échanger des titres d'un Fonds Mackenzie souscrits antérieurement en vertu de ces modes de souscription avec frais d'acquisition différés contre des titres d'autres Fonds Mackenzie, en vertu du même mode de souscription, jusqu'à l'expiration du délai prévu dans le barème des frais de rachat. Pour de plus amples renseignements, veuillez vous reporter au prospectus simplifié du Fonds et à l'aperçu du Fonds.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### a) Constitution du Fonds et renseignements sur les séries (suite)

Série	Date d'établissement/ de rétablissement	Frais de gestion	Frais d'administration
Série A	31 mars 2008	1,85 %	0,24 %
Série AR	19 novembre 2014	1,85 %	0,27 %
Série B	24 novembre 2006	1,85 %	0,24 %
Série D	19 mars 2014	0,85 %	0,16 %
Série F	23 octobre 2006	0,70 %	0,15 %
Série F8	1 <sup>er</sup> juin 2018	0,70 %	0,15 %
Série FB	26 octobre 2015	0,85 %	0,24 %
Série G	25 novembre 2016	1,35 %	0,24 %
Série GF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GF8	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GLF	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GO	17 juin 2023	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série GPW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWFB	17 juin 2023	0,65 %	0,15 %
Série GPWT8	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série GPWX	17 juin 2023	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GPWX8	17 juin 2023	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série GW	17 juin 2023	1,65 %	0,15 %
Série I	24 novembre 2006	1,25 %	0,24 %
Série OJ	25 novembre 2016	1,70 %	0,20 %
Série O	24 novembre 2006	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série O5	12 janvier 2016	— <sup>1)</sup>	s.o.
Série PW	30 octobre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWFB	3 avril 2017	0,70 %	0,15 %
Série PWR	1 <sup>er</sup> avril 2019	1,70 %	0,15 %
Série PWT5	3 avril 2017	1,70 %	0,15 %
Série PWT8	16 décembre 2013	1,70 %	0,15 %
Série PWX	30 juin 2014	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série PWX8	10 février 2015	— <sup>2)</sup>	— <sup>2)</sup>
Série R	6 juin 2023	s.o.	s.o.
Série S	31 octobre 2017	— <sup>1)</sup>	0,025 %
Série T5	23 octobre 2006	1,85 %	0,24 %
Série T8	24 octobre 2018	1,85 %	0,24 %
Série LB	17 juin 2023	1,85 %	0,24 %
Série LF	17 juin 2023	0,70 %	0,15 %
Série LW	17 juin 2023	1,70 %	0,15 %

1) Ces frais sont négociables et sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série.

2) Ces frais sont payables directement à Mackenzie par les investisseurs dans cette série par l'entremise du rachat de leurs titres.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### b) Reports prospectifs de pertes fiscales

À la fin de la dernière année d'imposition, aucune perte en capital ni autre qu'en capital n'était disponible pour un report prospectif aux fins de l'impôt.

#### c) Prêt de titres

	30 septembre 2024	31 mars 2024
	(\$)	(\$)
Valeur des titres prêtés	204 547	151 225
Valeur des biens reçus en garantie	218 462	159 260

	30 septembre 2024		30 septembre 2023	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
Revenus de prêts de titres bruts	99	100,0	140	100,0
Impôt retenu à la source	(3)	(3,0)	(2)	(1,4)
	96	97,0	138	98,6
Paiements à l'agent de prêt de titres	(17)	(17,2)	(25)	(17,9)
Revenu tiré du prêt de titres	79	79,8	113	80,7

#### d) Commissions

	(\$)
30 septembre 2024	122
30 septembre 2023	105

#### e) Risques découlant des instruments financiers

##### i. Exposition au risque et gestion du risque

Le Fonds vise une croissance du capital à long terme assortie d'un revenu en investissant principalement dans des titres à revenu fixe et/ou des actions axés sur le revenu partout dans le monde. Selon la conjoncture économique et les évaluations relatives des conseillers en valeurs du Fonds, ce dernier investira généralement de 30 % à 70 % de son actif dans des titres de capitaux propres et dans des titres à revenu fixe, mais il peut investir jusqu'à 100 % de son actif dans l'une ou l'autre de ces catégories d'actifs.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### ii. Risque de change

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de change.

Devise	30 septembre 2024				Incidence sur l'actif net			
	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 285 468	8 378	(469 417)	824 429				
EUR	204 467	(1 818)	(58 213)	144 436				
GBP	162 136	(2 334)	(39 745)	120 057				
JPY	57 755	2 127	(1 010)	58 872				
NTD	20 904	–	–	20 904				
CHF	33 548	–	(13 345)	20 203				
SEK	18 866	–	1 007	19 873				
ZAR	18 572	–	–	18 572				
SGD	18 137	–	–	18 137				
HKD	11 817	–	–	11 817				
DKK	11 559	–	–	11 559				
INR	11 260	–	–	11 260				
BRL	9 853	–	–	9 853				
NOK	–	–	2 014	2 014				
NZD	40 433	–	(39 207)	1 226				
AUD	–	(20)	327	307				
MXN	6 665	–	(6 606)	59				
Total	1 911 440	6 333	(624 195)	1 293 578				
% de l'actif net	85,9	0,3	(28,1)	58,1				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(63 568)	(2,9)	65 956	3,0

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### ii. Risque de change (suite)

31 mars 2024

Devise	Placements (\$)	Trésorerie et placements à court terme (\$)	Instruments dérivés (\$)	Exposition nette* (\$)	Incidence sur l'actif net			
					Renforcement de 5 %		Affaiblissement de 5 %	
					(\$)	%	(\$)	%
USD	1 081 893	109 000	(261 580)	929 313				
GBP	81 935	9	6 905	88 849				
EUR	218 250	(15)	(149 490)	68 745				
JPY	51 173	(169)	5 047	56 051				
BRL	35 677	–	–	35 677				
DKK	22 483	119	–	22 602				
NTD	20 872	–	–	20 872				
MXN	67 096	–	(47 908)	19 188				
CHF	29 600	–	(13 624)	15 976				
ZAR	14 610	–	–	14 610				
SGD	14 409	–	–	14 409				
INR	10 533	–	–	10 533				
HKD	5 037	96	–	5 133				
CNY	3 038	1 946	–	4 984				
SEK	8 689	–	(8 177)	512				
NOK	–	–	437	437				
HUF	–	–	1	1				
THB	–	–	(1)	(1)				
AUD	–	27	(179)	(152)				
NZD	51 315	–	(51 884)	(569)				
Total	1 716 610	111 013	(520 453)	1 307 170				
% de l'actif net	80,4	5,2	(24,4)	61,2				
Total de la sensibilité aux variations des taux de change					(65 359)	(3,1)	65 359	3,1

\* Comprend les instruments financiers monétaires et non monétaires.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### e) Risques découlant des instruments financiers (suite)

##### iii. Risque de taux d'intérêt

Les tableaux ci-après résument l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt découlant de ses placements dans des obligations et des instruments dérivés selon la durée jusqu'à l'échéance.

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
<b>30 septembre 2024</b>						
Moins de 1 an	14 231	(55 227)				
1 an à 5 ans	206 594	–				
5 ans à 10 ans	533 666	–				
Plus de 10 ans	124 949	–				
Total	879 440	(55 227)				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(55 013)	(2,5)	55 013	2,5

	Obligations (\$)	Instruments dérivés (\$)	Incidence sur l'actif net			
			Augmentation de 1 %		Diminution de 1 %	
			(\$)	(%)	(\$)	(%)
<b>31 mars 2024</b>						
Moins de 1 an	10 814	26 053				
1 an à 5 ans	199 545	–				
5 ans à 10 ans	379 478	–				
Plus de 10 ans	183 245	–				
Total	773 082	26 053				
Total de la sensibilité aux variations des taux d'intérêt			(58 083)	(2,7)	58 083	2,7

##### iv. Autre risque de prix

Le tableau ci-après résume l'exposition du Fonds à l'autre risque de prix.

Incidence sur l'actif net	Augmentation de 10 %		Diminution de 10 %	
	(\$)	(%)	(\$)	(%)
30 septembre 2024	129 201	5,8	(129 201)	(5,8)
31 mars 2024	123 357	5,8	(123 285)	(5,8)

##### v. Risque de crédit

Pour ce Fonds, la plus forte concentration du risque de crédit se trouve dans les titres de créance, tels que les obligations. La juste valeur des titres de créance tient compte de la solvabilité de l'émetteur de ces titres. L'exposition maximale à tout émetteur de titres de créance au 30 septembre 2024 était de 13,3 % de l'actif net du Fonds (6,4 % au 31 mars 2024).

Au 30 septembre 2024 et au 31 mars 2024, les titres de créance par note de crédit étaient les suivants :

Note des obligations*	30 septembre 2024	31 mars 2024
	% de l'actif net	% de l'actif net
AAA	4,4	6,2
AA	16,6	7,8
A	2,3	3,0
BBB	7,7	9,7
Inférieure à BBB	4,9	6,0
Sans note	3,6	3,5
Total	39,5	36,2

\* Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### f) Classement de la juste valeur

Le tableau ci-après résume la juste valeur des instruments financiers du Fonds selon la hiérarchie de la juste valeur décrite à la note 3.

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	–	878 735	705	879 440	–	772 886	196	773 082
Actions	798 071	439 694	422	1 238 187	1 189 359	2	362	1 189 723
Options	–	846	–	846	–	79	–	79
Fonds/billets négociés en bourse	22 123	–	–	22 123	23 563	–	–	23 563
Fonds communs de placement	19 352	–	–	19 352	7 579	–	–	7 579
Fonds privés	–	–	12 352	12 352	–	–	12 890	12 890
Actifs dérivés	188	6 466	–	6 654	591	2 019	–	2 610
Passifs dérivés	(302)	(4 288)	–	(4 590)	(45)	(3 589)	–	(3 634)
Placements à court terme	–	19 826	–	19 826	–	96 847	–	96 847
<b>Total</b>	<b>839 432</b>	<b>1 341 279</b>	<b>13 479</b>	<b>2 194 190</b>	<b>1 221 047</b>	<b>868 244</b>	<b>13 448</b>	<b>2 102 739</b>

La méthode du Fonds consiste à comptabiliser les transferts vers ou depuis les différents niveaux de la hiérarchie de la juste valeur à la date de l'événement ou du changement de circonstances à l'origine du transfert.

Au cours de la période close le 30 septembre 2024, les actions autres que nord-américaines étaient fréquemment transférées entre le niveau 1 (prix non rajustés cotés) et le niveau 2 (prix rajustés). Au 30 septembre 2024, ces titres étaient classés dans le niveau 2 (niveau 1 au 31 mars 2024).

Au cours de la période close le 30 septembre 2024, des placements d'une juste valeur de 2 \$ (200 \$ au 31 mars 2024) ont été transférés du niveau 2 au niveau 3 en raison de changements en matière de données utilisées pour l'évaluation.

Le tableau ci-après présente un rapprochement des instruments financiers évalués à la juste valeur à l'aide de données non observables (niveau 3) pour les périodes closes le 30 septembre 2024 et le 31 mars 2024 :

	30 septembre 2024				31 mars 2024			
	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)	Obligations (\$)	Actions (\$)	Fonds privés (\$)	Total (\$)
Solde, à l'ouverture	196	362	12 890	13 448	–	343	12 772	13 115
Achats	516	–	223	739	–	–	233	233
Ventes	–	–	(354)	(354)	–	(26)	–	(26)
Transferts entrants	–	2	–	2	200	–	–	200
Transferts sortants	–	–	–	–	–	–	–	–
Profits (pertes) au cours de la période :								
Réalisé(e)s	–	–	34	34	–	14	–	14
Latent(e)s	(7)	58	(441)	(390)	(4)	31	(115)	(88)
<b>Solde, à la clôture</b>	<b>705</b>	<b>422</b>	<b>12 352</b>	<b>13 479</b>	<b>196</b>	<b>362</b>	<b>12 890</b>	<b>13 448</b>
Variation des profits (pertes) latent(e)s au cours de la période attribuables aux titres détenus à la clôture de la période	(7)	58	(441)	(390)	(4)	38	(115)	(81)

Le changement d'une ou de plusieurs données donnant lieu à d'autres hypothèses raisonnablement possibles pour évaluer les instruments financiers du niveau 3 n'entraînerait aucune variation importante de la juste valeur de ces instruments.

#### g) Placements détenus par le gestionnaire et des sociétés affiliées

Les placements détenus par le gestionnaire, d'autres fonds gérés par le gestionnaire et des fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire, investis dans les séries CL, IG ou S du Fonds, le cas échéant (comme il est décrit à la rubrique *Constitution du Fonds et renseignements sur les séries* de la note 10), s'établissaient comme suit :

	30 septembre 2024	31 mars 2024
	(\$)	(\$)
Gestionnaire	1 428	1 324
Autres fonds gérés par le gestionnaire	1	1
Fonds gérés par des sociétés affiliées au gestionnaire	2	2

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### h) Compensation d'actifs financiers et de passifs financiers

Les tableaux ci-après présentent les actifs financiers et passifs financiers qui font l'objet d'une convention-cadre de compensation ou d'autres conventions semblables et l'incidence nette sur les états de la situation financière du Fonds si la totalité des droits à compensation était exercée dans le cadre d'événements futurs comme une faillite ou la résiliation de contrats. Aucun montant n'a été compensé dans les états financiers.

	30 septembre 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	4 285	(1 995)	–	2 290
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(4 445)	1 995	1 497	(953)
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	(160)	–	1 497	1 337

	31 mars 2024			
	Montant brut des actifs (passifs) (\$)	Disponible pour compensation (\$)	Couvertures (\$)	Montant net (\$)
Profits latents sur les contrats dérivés	2 459	(1 403)	–	1 056
Pertes latentes sur les contrats dérivés	(2 358)	1 403	3 341	2 386
Obligation pour options vendues	–	–	–	–
Total	101	–	3 341	3 442

#### i) Intérêts dans des entités structurées non consolidées

Les détails des placements du Fonds dans des fonds sous-jacents au 30 septembre 2024 et au 31 mars 2024 sont les suivants :

30 septembre 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,7	8 635
Fonds de titres à revenu fixe de sociétés mondiales Mackenzie, série R	1,0	1 633
FNB mondial de dividendes Mackenzie	2,1	3 175
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	6 120
Fonds de titres à taux variable de qualité Mackenzie, série R	3,6	9 542
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,3	6 561
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	10,0	4 193
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 616
Northleaf Private Credit II LP	1,0	8 051
Sagard Credit Partners II LP	0,8	4 301

31 mars 2024	% de l'actif net du Fonds sous-jacent	Juste valeur des placements du Fonds (\$)
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	1,5	8 802
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	3,2	5 964
Fonds international de dividendes Mackenzie, série R	1,2	6 043
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	11,4	4 087
Fonds de revenu fixe sans contraintes Mackenzie, série R	0,1	1 536
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,0	4 710
Northleaf Private Credit II LP	1,0	8 554
Sagard Credit Partners II LP	0,7	4 336

# FONDS DE REVENU STRATÉGIQUE MONDIAL MACKENZIE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES NON AUDITÉS | 30 septembre 2024

## NOTES ANNEXES

### 10. Renseignements propres au Fonds (en milliers, sauf pour a)) (suite)

#### j) Engagement

	30 septembre 2024		31 mars 2024	
	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)	Montant appelé (\$ US)	Engagement d'investissement total (\$ US)
Northleaf Private Credit II LP <sup>1)</sup>	6 556	8 114	6 556	8 114
Sagard Credit Partners II LP <sup>2)</sup>	2 732	8 114	2 873	8 114

<sup>1)</sup> Ce fonds est géré par Northleaf Capital Partners (Canada) Ltd., une société affiliée à Mackenzie.

<sup>2)</sup> Ce fonds est géré par Sagard Holdings Inc., une société affiliée à Mackenzie.

#### k) Fusion de fonds

La fusion du Mandat privé équilibré de revenu mondial Mackenzie (le « Fonds dissous ») avec le Fonds a eu lieu le 16 juin 2023. Cette fusion a été réalisée avec report d'impôt. Puisque le Fonds dissous investissait la totalité de son actif net dans la série R du Fonds avant la fusion, la fusion a été effectuée en échangeant 8 187 titres de série R contre d'autres titres du Fonds à la juste valeur de marché, ne donnant lieu à aucun transfert d'actif net au Fonds.

Séries du Fonds dissous	Séries du Fonds	Titres émis
Série LF	Série GLF	300
Série LW	Série GW	76
Série O	Série GO	4
Série PW	Série GPW	2 559
Série PWF	Série GF	1 947
Série PWF8	Série GF8	74
Série PWFB	Série GPWFB	320
Série PWT8	Série GPWT8	11
Série PWX	Série GPWX	181
Série PWX8	Série GPWX8	–

Par suite de la fusion, le Fonds dissous a été fermé. Les charges engagées dans le cadre de la fusion ont été acquittées par Mackenzie.

#### l) Chiffres correspondants

Certains chiffres correspondants de la période précédente ont été reclassés pour que leur présentation soit conforme à la présentation adoptée pour la période considérée.